SETUPS

SUMÁRIO

Setups Introdução 02
Topo Duplo....03
Deriva....04
Alargamento....05
Triângulo Baixista....06
Triângulo Simétrico....07
Triângulo Altista....08
Retângulo....09
Cunho Altista....10
Cunho Baixista....11
Mastro e Bandeira....12
Cup And Handle (Xícara com alça)....13
Fundo Duplo....14
Ombro Cabeça Ombro Invertido (OCOI)....15
Ombro Cabeça Ombro (OCO)....16
Ilha de Reversão....17
Diamante....18

METODO BISI DE DAYTRADE

Introdução....20
Power Breakout....21
Barra de Ignição (BI)....22
Barra Elefante....23
Ilha....24
1º Movimento Exótico....25
Rompimento....26
Twin Towers....27
Open Power BreakOut....28
Linha D'água (LD)....29
Fechamento do GAP....30
1º Movimento....31
Pivot....32
Teste da Linha D'água (LTD)....33
Retorno a Média (RAM) ou Contra-Tendência (CT)....34
Monster GAP....35
Rompimento da Linha D'Água....36
Teste de GAP....37
Rompimento Falso....38
Gift....39

METODO BISI DE SWING TADE

Introdução....41
Retorno à Média....43

SUMÁRIO

Fundo Reflexão....44
Rompimento....45
Rompimento Confirmado....46
GAP de Fuga....47
Barra de Ignição....48
Correção....49

METODO LEANDRO DE DAYTRADE

Introdução....51
Setup 1....53
Setup 1 - Movimento Exótico....54
Setup 3....55
Setup 2....56

METODO LEANDRO DE SWINGTRADE

Correção....58
Rompimento....59
Contra-Tendência....60

METODO STORMER DE POSITIONTRADE

Dave Landry....62
IFR14 - Ajustado....63
Semana Explosiva (Blast Off)....64
Retângulo em Topo para Cima....65
Duas Semanas de Queda....66

METODO STORMER DE SWINGTRADE

1-2-3....68
Realização Frustada....69
IRF2....70

METODO WILLIAM DE DAYTRADE

Red Bar Ignored (RBI) - Green Ignored (GBI)....72
Trap Zone (TZ)....73
Top Tail Take Out (TTTO / Bottom Tail Take Out (BTTO)....75
Filling The GAP (FTG)....76
Barra Elefante....76
Green Wall (GW)....77
Bull 180º / Bear 180º....78
Localização (LOC)....79
Bottom Tail (BT) TOP Tail (TT)....80
Grenn Bar OUT (GBTO) Red Bar Take OUT (RBTO) 81

Introdução

Os padrões complexos recebem esse nome por serem formados por uma quantidade indefinida de candles. Eles se explicam por um reflexo do comportamento de massa dos participantes do mercado, que quando dominados pelas emoções que o mercado instiga, dificilmente fogem do comportamento instintivo de massa.

Costumam indicar não somente o momento de se posicionar, como também o objetivo de preço para as próximas movimentações. Além dessas características em comum entre os padrões, a diminuição de volume na formação deles é bastante frequente – análogo a isso, o aumento de volume pouco antes do rompimento é a regra. Outro ponto diz respeito ao número de estruturas (fundos e topos) do padrão: aceitamos padrões com apenas quatro toques, mas é indubitável que os de cinco são muito mais confiáveis para se operar. E lembre-se: operar a favor da tendência prévia ao padrão resulta em uma quantidade maior de trades vencedores.

Setups

Topo duplo

Padrão de: reversão

Alvo: amplitude da resistência ao suporte projetada a partir do ponto do rompimento

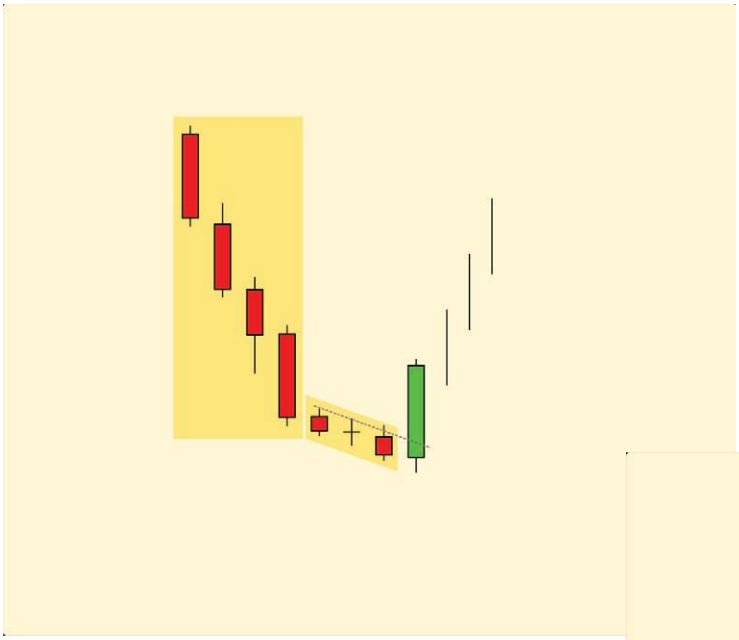
Também conhecidos com topo em “M”, são caracterizados por dois topos no mesmo nível, formados depois de
um movimento direcional agudo. O fundo formado entre os dois topos (montanhas) é chamado de vale – o
padrão é acionado quando esse vale é rompido. É bastante corriqueiro ver um possível topo duplo se
formando. Isso ocorre toda que vez os preços relutam, depois de um movimento de alta, a ultrapassar o topo
anterior. O novato percebe nisso um topo duplo e tende a se desfazer de suas posições ou apostar na
correção. O profissional sabe que, numa situação dessas, a formação de um topo duplo efetivo é a menor das
probabilidades. É mais provável que os candles consigam romper esse patamar ou, caso não o façam de
imediato, surja uma formação de triângulo altista ou retângulo. Novamente: o topo duplo só ocorre quando o
vale é rompido.

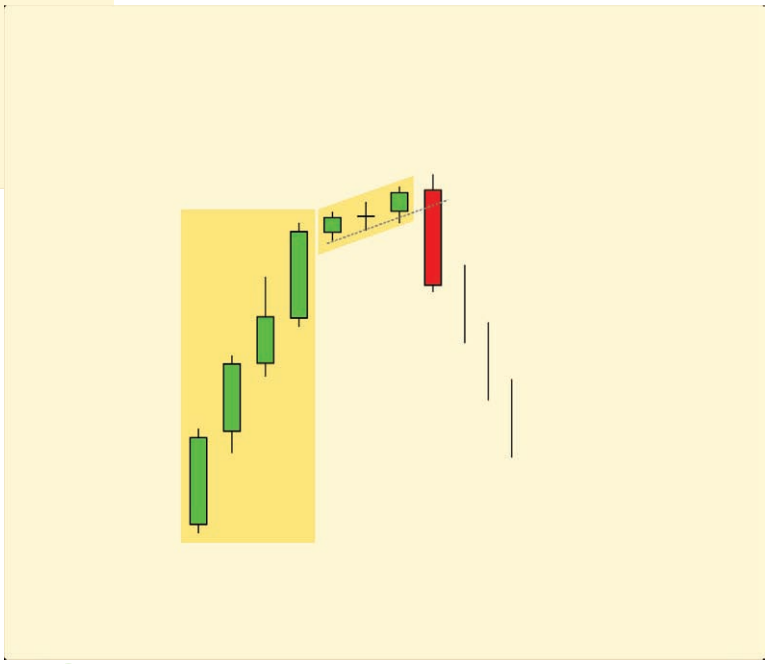
Assim como os OCOs, essa formação exibe uma característica de simetria. Existe um eixo vertical de simetria
que passa pelo vale e que orienta os preços no seu desenvolvimento após o rompimento do padrão.

Atenção! Nunca antecipe topos duplos, o mais provável é que o mercado siga na direção anterior sem acionar
o padrão de reversão.

Padrão de: reversão

Esse padrão é muito similar ao mastro bandeira, com exceção de dois pontos: a inclinação da bandeira e a figura ser de reversão. A deriva apresenta dois movimentos principais, a primeira pernada de impulsão e, posteriormente, a formação de um canal no mesmo sentido da perna prévia (indicando que a força vigente está cansando). O padrão é acionado assim que há o rompimento da LTA (na reversão baixista) ou da LTB (na reversão altista). Usualmente, a perda das linhas de tendência indica forte possibilidade de correção ou ainda a provável reversão de tendência para um médio prazo.





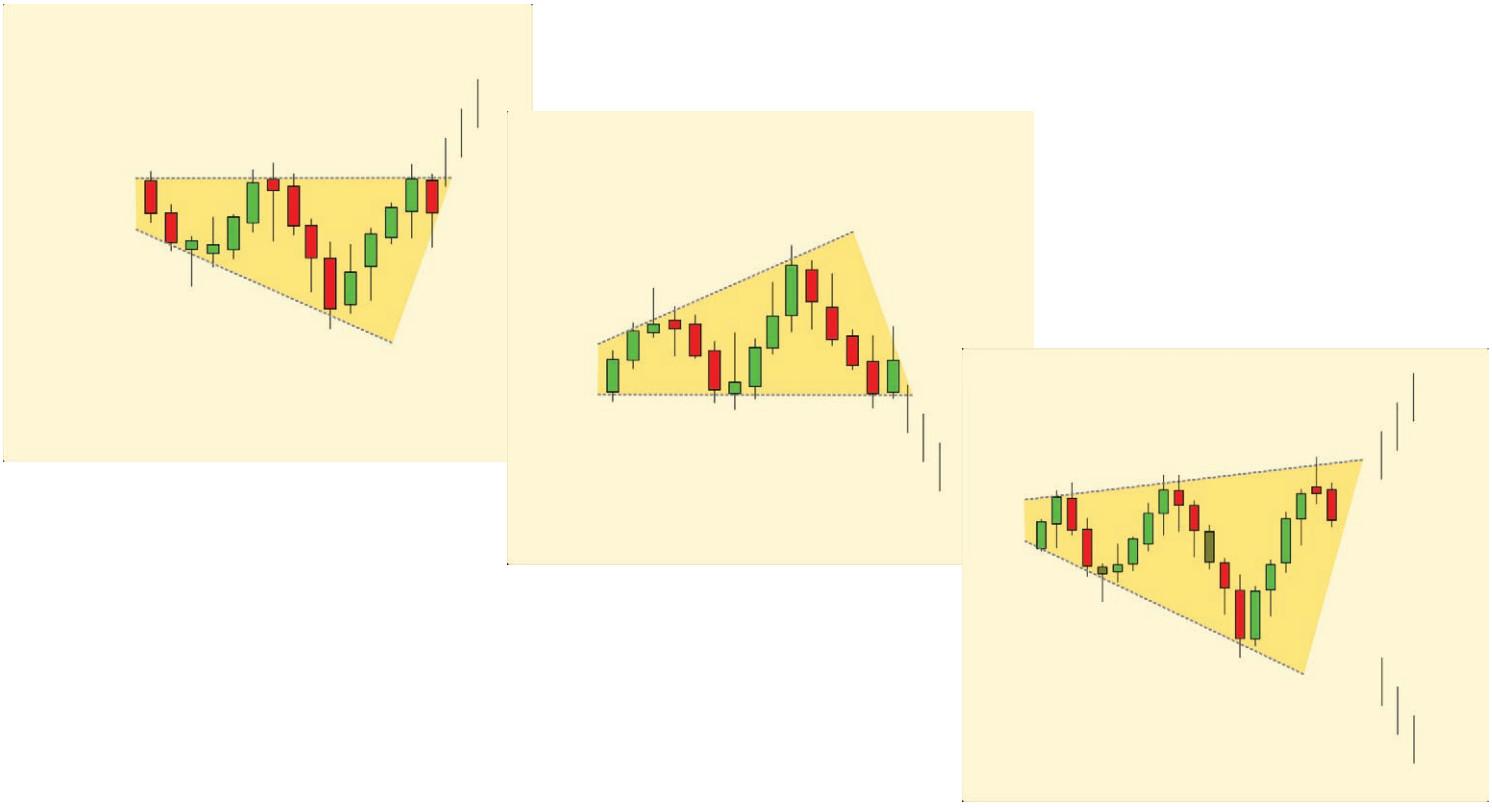
Alargamentos

São padrões que geralmente aparecem próximo do fim de uma tendência. São idênticos com os triângulos simétricos (para alargamentos simétricos) e triângulos altistas/baixista (para alargamentos retos), mas assumem o aspecto inverso deles – tendo como base um eixo vertical na figura.

O alargamento simétrico consiste em uma LTB (suporte) e uma LTA (resistência), sendo cada fundo mais baixo que o fundo anterior, e cada topo mais alto do que o topo anterior. A simetria nesse padrão se dá por um eixo horizontal traçado na metade da figura.

Diferentemente dos triângulos simétricos, nos alargamentos as linhas de tendência não costumam ser respeitadas, o que dificulta os seus traçados e sua operacionalização.

Atenção! Atuar nesse padrão é muito arriscado por gerar falsos sinais de rompimento. Ao contrário do que é comum no mercado, em que rompimento tendem a iniciar movimentos na sua direção, aqui os rompimentos de topos e fundos prévios tendem a marcar o final do movimento, retornando para a linha de tendência oposta. Já os rompimentos nos alargamentos retos são tranquilos de operar, pois as linhas de resistência ou suporte são retas bem definidas.



Triângulo baixista

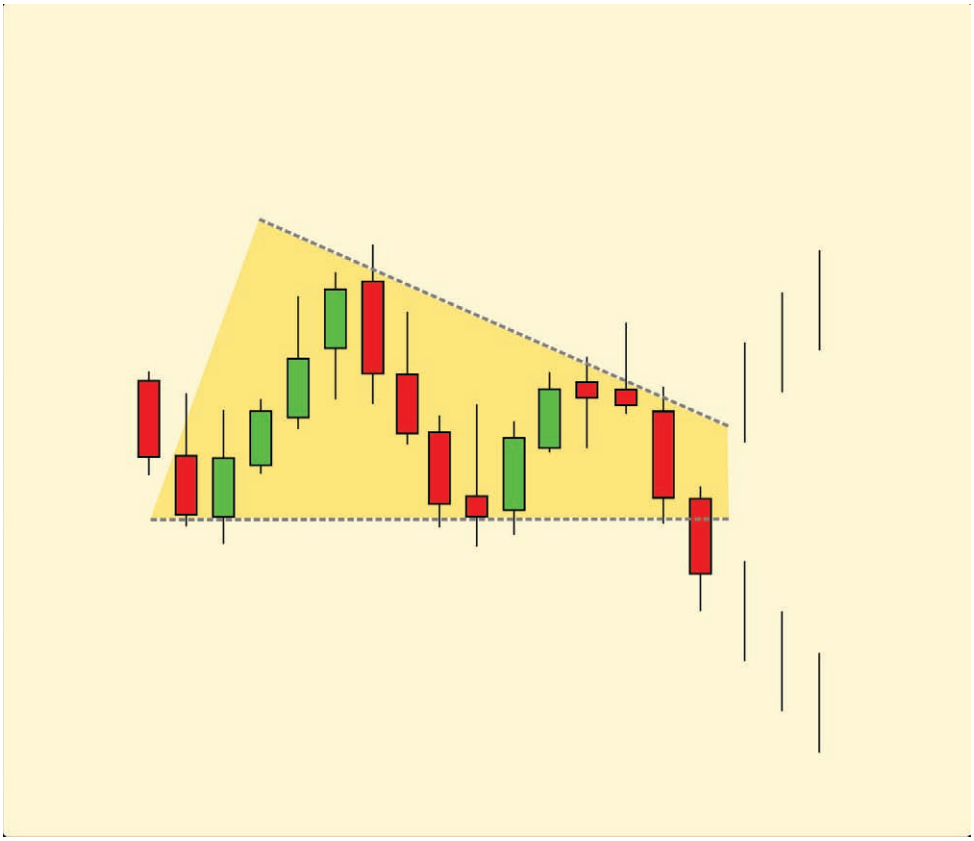
Padrão de: continuação/reversão

Alvo: amplitude do 1º topo ao suporte projetada a partir do ponto do rompimento

Incidência de pullback: 20% dos casos

A formação do triângulo baixista vem da formação de topos cada vez mais baixos e fundos no mesmo nível. São necessários, pelo menos, dois topos e dois fundos para traçar as retas – marcamos a LTB nos topos e o suporte horizontal nos fundos.

O aparecimento de triângulos baixistas é mais comum em movimentações de queda, mas também pode aparecer em pernas ascendentes. O rompimento, nesse padrão, é apenas baixista. O rompimento para baixo, rompendo a LTA, descaracteriza o padrão – e, nesse caso, devemos deixar de considerá-lo. Quando isso ocorre, geralmente surge outro padrão (como um retângulo). Nos triângulos altistas, o rompimento pode ocorrer bem distante do vértice.



Triângulo simétrico

Padrão de: continuação/reversão

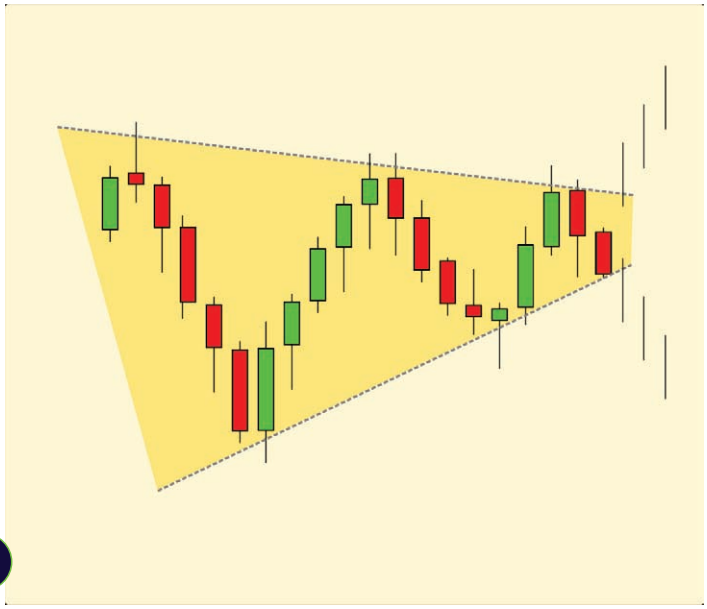
Alvo: distância do 1º fundo ao 1º topo, projetado a partir do ponto de rompimento

Incidência de pullback: 30% dos casos

A formação do triângulo simétrico vem de uma contração dos preços, na qual percebemos o gráfico fazendo topos mais baixos e fundos mais altos. São necessários, pelo menos, dois topos e dois fundos para traçar as linhas de tendência – marcamos a LTA nos fundos e a LTB nos topos. Para termos certeza do padrão exigimos a formação de cinco estruturas (3 fundos e 2 topos ou 3 topos e 2 fundos) ou mais.

O triângulo simétrico recebe esse nome por possuir um aspecto mais ou menos simétrico em relação a um eixo horizontal traçado a partir do vértice (onde a LTA e a LTB se unem). Na prática, isso não significa que com o traçado do eixo, a parte inferior tenha que ser igual à parte superior. É desejável que sejam similares, mas dificilmente o eixo demarcará uma simetria inferior e superior perfeita. O que de fato é importante nesse sentido, é que o primeiro topo e o primeiro fundo não estejam distantes no tempo.

O acionamento do padrão se dá quando acontecer o rompimento da LTA ou da LTB, que tende a acontecer em um ponto situado entre a metade do padrão e um pouco antes do vértice da figura (algo em torno de 3/4 da formação). Se o padrão alcançar o vértice antes de romper, desconsidere-o.



Triângulo altista

Padrão de: continuação/reversão

Alvo: amplitude do 1º fundo a resistência projetada a partir do ponto do rompimento

Incidência de pullback: 20% dos casos

A formação do triângulo altista vem da formação de fundos cada vez mais altos e topos no mesmo nível. São necessários, pelo menos, dois fundos e dois topos para traçar as retas – marcamos a LTA nos fundos e a resistência horizontal nos topos.

O aparecimento de triângulos altistas é mais comum em movimentações de alta, mas também pode aparecer em pernas descendentes. O rompimento, nesse padrão, é apenas altista. O rompimento para baixo, rompendo a LTA, descaracteriza o padrão – e, nesse caso, devemos deixar de considerá-lo. Quando isso ocorre, geralmente surge outro padrão (como um retângulo). Nos triângulos altistas, o rompimento pode ocorrer bem distante do vértice.

Setups

Retângulo

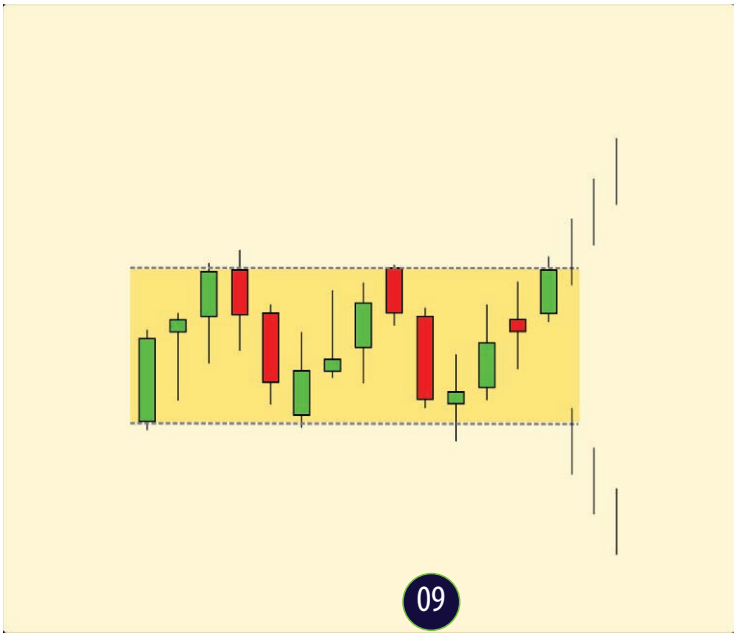
Padrão de: continuação/reversão

Alvo: amplitude do suporte a resistência projetada a partir do ponto do rompimento

Esse padrão ocorre quando temos dois topos respeitando uma mesma linha de resistência e dois fundos respeitando uma mesma linha de suporte (em suma, uma tendência lateral bem definida).

O retângulo oferece oportunidades tanto para operar dentro da formação, quanto no seu rompimento. Apesar de sua simplicidade, muitos trades perdem excelentes oportunidades de operar dentro da formação porque aguardam dois topos e dois fundos confirmados para, então, buscar uma posição no quinto ou no sexto toque. Ocorre que, muitas vezes, o padrão se desfaz ou rompe nessa altura de tempo.

Sempre que, numa tendência de alta, forem feitos dois topos no mesmo nível, fique atento ao teste do fundo anterior. Nesse patamar, busque sinais de candle para entrar na ponta compradora, antecipando o quarto toque e, assim, a formação de retângulo. Se a tendência for de baixa, fique atento para a formação de dois fundos no mesmo patamar. Caso o topo anterior seja novamente testado, busque oportunidade de venda, antecipando a confirmação do retângulo. Esse quarto toque é o ponto ideal para fazer uma operação, desde que você esteja operando a favor do movimento prévio.



Cunha altista

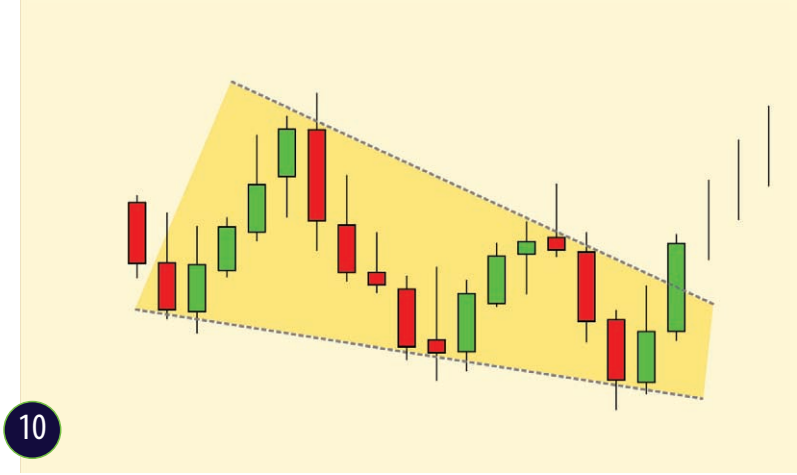
Padrão de: reversão

Alvo: amplitude do 1º topo ao vértice projetada a partir do ponto do rompimento

O que ocorre nessa formação é que os vendedores forçam o mercado para baixo, vendendo cada vez mais pesado na expectativa de conseguir derrubar os preços com violência. A cada tentativa o mercado cede, mas logo que os vendedores cessam a pressão, o mercado se recupera. Alguns vendedores começam a desistir e a recomprar suas posições, fazendo com que os preços subam perigosamente. Conforme mais vendas são encerradas, os preços sobem e rompem a LTB superior. Esse rompimento pressiona os demais vendedores a correrem ao mercado para fechar suas posições, e o mercado sofre um forte rali.

A característica da cunha altista é ter duas linhas inclinadas para baixo com uma diferença no grau de inclinação, fazendo com que venham a convergir no futuro. A linha superior serve de resistência, sendo uma LTB. A linha de baixo é uma linha de retorno, servindo de suporte. A inclinação da formação resultante é baixista. Por isso, são também chamadas de cunhas descendentes. Fique atento, porque, quando a inclinação da linha de retorno é pequena, o padrão é facilmente confundível com um triângulo baixista.

Atenção! É muito comum haver confusão para distinguir cunhas e triângulos simétricos. A condição que deve ser levada em questão para não haver esse engano é a angulação das retas: enquanto nas cunhas as retas (LTA's para cunha baixista e LTB's para cunhas altistas) convergem para um mesmo lado (para cima ou para baixo), os triângulos simétricos tem suas retas (LTA e LTB) convergindo para lados opostos (uma inclinada para cima e a outra para baixo).



Setups

Cunha baixista

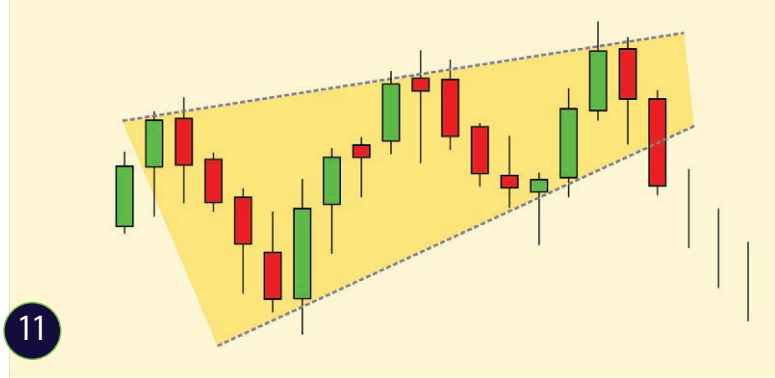
Padrão de: reversão

Alvo: amplitude do 1º fundo ao vértice projetada a partir do ponto do rompimento

O que ocorre nessa formação é que os compradores forçam o mercado para cima, comprando cada vez mais pesado na expectativa de conseguir levantar os preços com violência. A cada tentativa o mercado sobe, mas logo que os compradores cessam a pressão, o mercado cai. Alguns compradores começam a desistir e a vender suas posições, fazendo com que os preços caiam perigosamente. Conforme mais compras são encerradas, os preços caem e rompem a LTA inferior. Esse rompimento pressiona os demais compradores a correrem ao mercado para fechar suas posições, e o mercado sofre uma forte queda.

A característica da cunha baixista é ter duas linhas inclinadas para cima com uma diferença no grau de inclinação, fazendo com que venham a convergir no futuro. A linha de baixo é uma linha de retorno, servindo de suporte. A linha superior serve de resistência, sendo uma LTA. A inclinação da formação resultante é altista. Por isso, são também chamadas de cunhas ascendentes. Fique atento, porque, quando a inclinação da linha de retorno é pequena, o padrão é facilmente confundível com um triângulo baixista.

Atenção! É muito comum haver confusão para distinguir cunhas e triângulos simétricos. A condição que deve ser levada em questão para não haver esse engano é a angulação das retas: enquanto nas cunhas as retas (LTA's para cunha baixista e LTB's para cunhas altistas) convergem para um mesmo lado (para cima ou para baixo), os triângulos simétricos tem suas retas (LTA e LTB) convergindo para lados opostos (uma inclinada para cima e a outra para baixo).



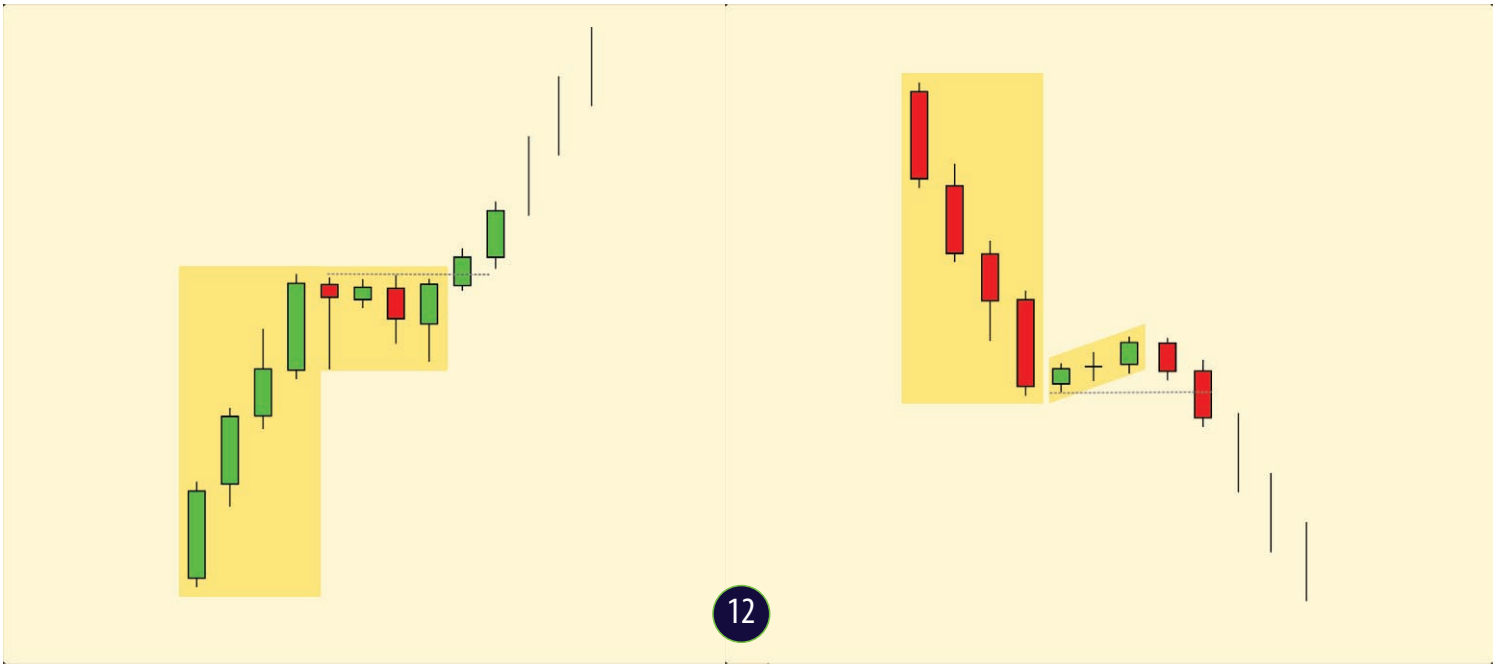
Setups

Mastro e bandeira

Padrão de: continuação

Alvo: amplitude do mastro projetada a partir do último fundo/topo da bandeira (ou flâmula)

Esse é um dos padrões complexos mais importante pelo fato de ser uma formação com alta probabilidade de ganho e alta frequência. A formação é caracterizada, inicialmente, por um forte movimento direcional (mastro), seguido por um período curto de consolidação (bandeira ou flâmula – usa-se o termo bandeira quando a consolidação assume um formato retangular; quando a consolidação tem formato de um triângulo, flâmula é o nome dado. Na prática, ambos os formatos têm a mesma potência). Quando a consolidação é rompida na direção do movimento prévio, o padrão é acionado e o que podemos esperar é um novo forte movimento direcional, de amplitude semelhante ao mastro.
Podemos entender esse padrão como uma demonstração da euforia (no padrão altista) ou do pânico (no padrão baixista), sendo o mastro o ínicio das emoções afloradas.
A característica da bandeira é que ela não pode ser grande demais em relação ao mastro e costuma aparecer com baixo volume. É comum que seja formada por candles de dúvida. Quando assume o aspecto de uma correção aguda, descaracteriza o padrão, apesar de que ele ainda pode se desenvolver.
Atenção para dois pontos! Mastros e bandeiras não oferecem pullback. Se perceber um ocorrendo, encerre a operação mesmo que não tenha atingido seu stop. Fique atento a à zona de objetivo de um mastro e bandeira: é um ponto muito forte como reversão. Se aparecer um candle de reversão nessa região, e ele for acionado, não deixe de operar.

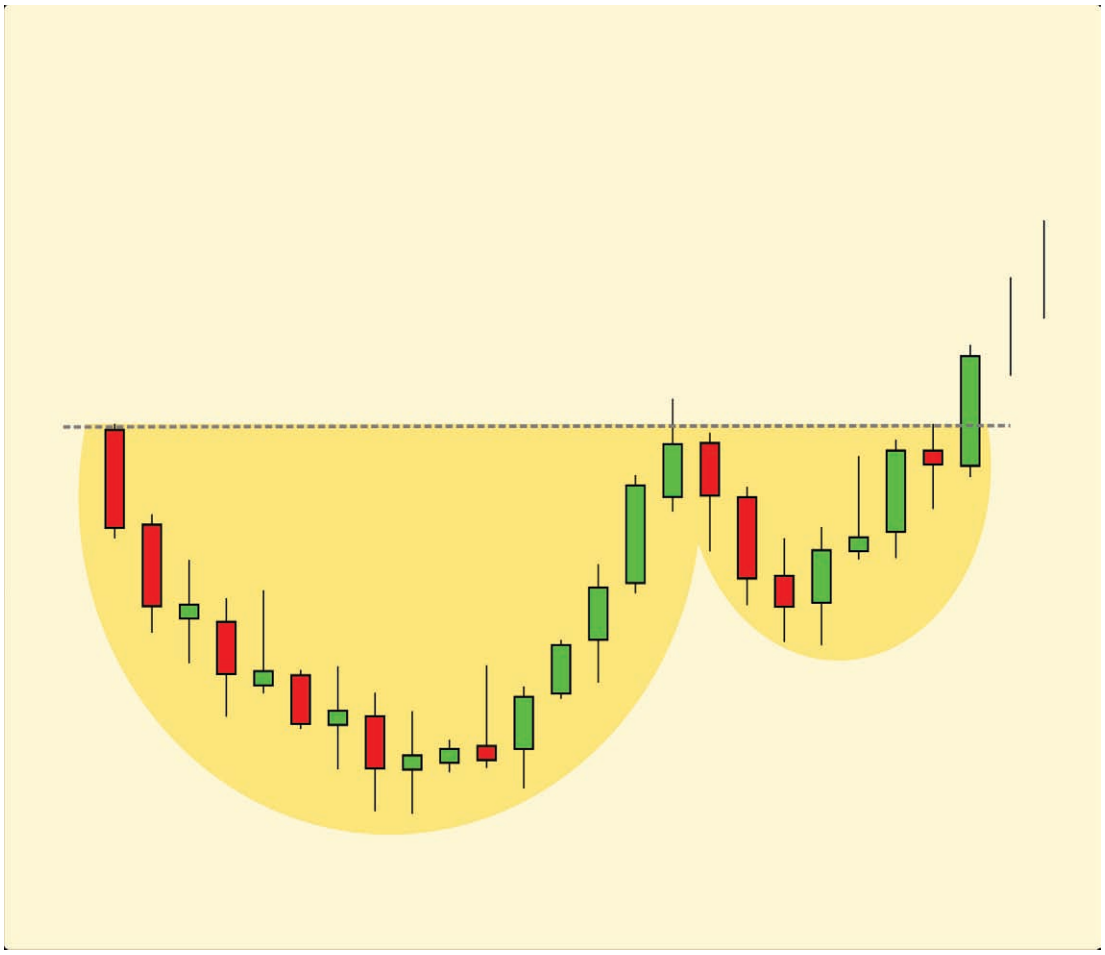


Cup and handle (Xícara com alça)

Padrão de: reversão

Alvo: amplitude do fundo da xícara a resistência projetada a partir do ponto do rompimento

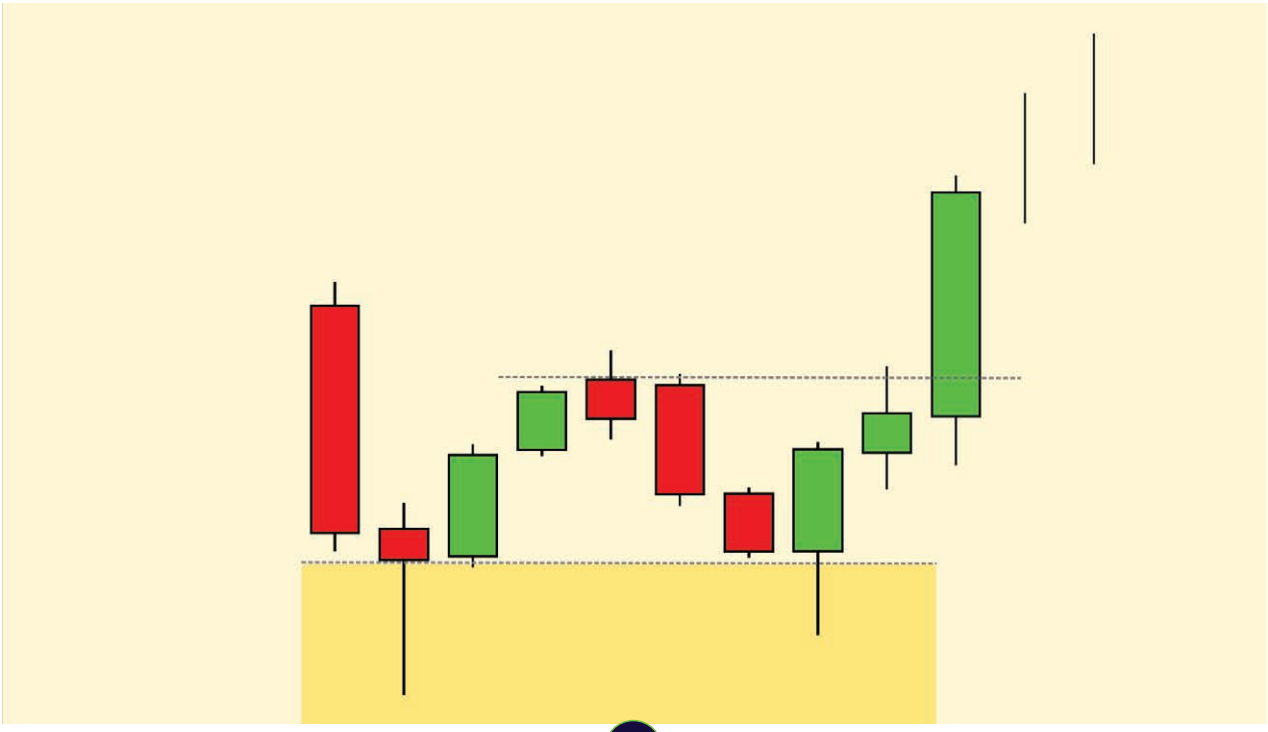
A figura é formada por duas partes, um fundo arrendado (cup) e um padrão ao lado desse fundo que pode ser uma bandeira, uma flâmula, uma cunha altista ou um mini fundo arredondado (handle). O padrão tende a acontecer após uma tendência de alta (mas a de baixo também é aceitável): assim que forma um topo o ativo começa a corrigir (por volta dos 50%) a perna prévia, formando um fundo arredondado, e recupera até as proximidades do topo. Após essa recuperação o ativo passa por uma nova de correção, mas dessa vez a amplitude da queda fica próximo dos 50% da altura do cup, voltando a testar novamente os topos do cup. O padrão é acionado assim que acontece o rompimento desses topos.



Fundo duplo

Padrão de: reversão

Alvo: amplitude do suporte a resistência projetada a partir do ponto do rompimento
É a formação oposta ao topo duplo. O fundo duplo deve aparecer depois de um movimento de queda, caracterizado por dois fundos no mesmo patamar de preço, seguidos do rompimento do topo entre eles. Nesse caso, os fundos serão os vales, e o topo será o platô da formação. Como pode-se perceber pela descrição e pela figura abaixo, trata-se de um pivot de alta do tipo menos frequente (dois fundos no mesmo nível).
Assim como os OCOs, essa formação exibe uma característica de simetria. Existe um eixo vertical de simetria que passa pelo platô e que orienta os preços no seu desenvolvimento após o rompimento do padrão. O acionamento do padrão se dá somente com o rompimento do platô. Quando a distância entre os fundos e o platô for grande e o mercado romper sem consolidação, evite a compra. Aguarde pacientemente o pullback, pois, nesses casos, eles são frequentes. Caso o rompimento se dê após uma consolidação ou caso a amplitude do padrão seja pequena, não espere pullback, pois dificilmente ocorrerá.
Atenção! Nunca antecipe fundos duplos, o mais provável é que o mercado siga na direção anterior sem acionar o padrão de reversão.



Ombro cabeça ombro invertido (OCOi)

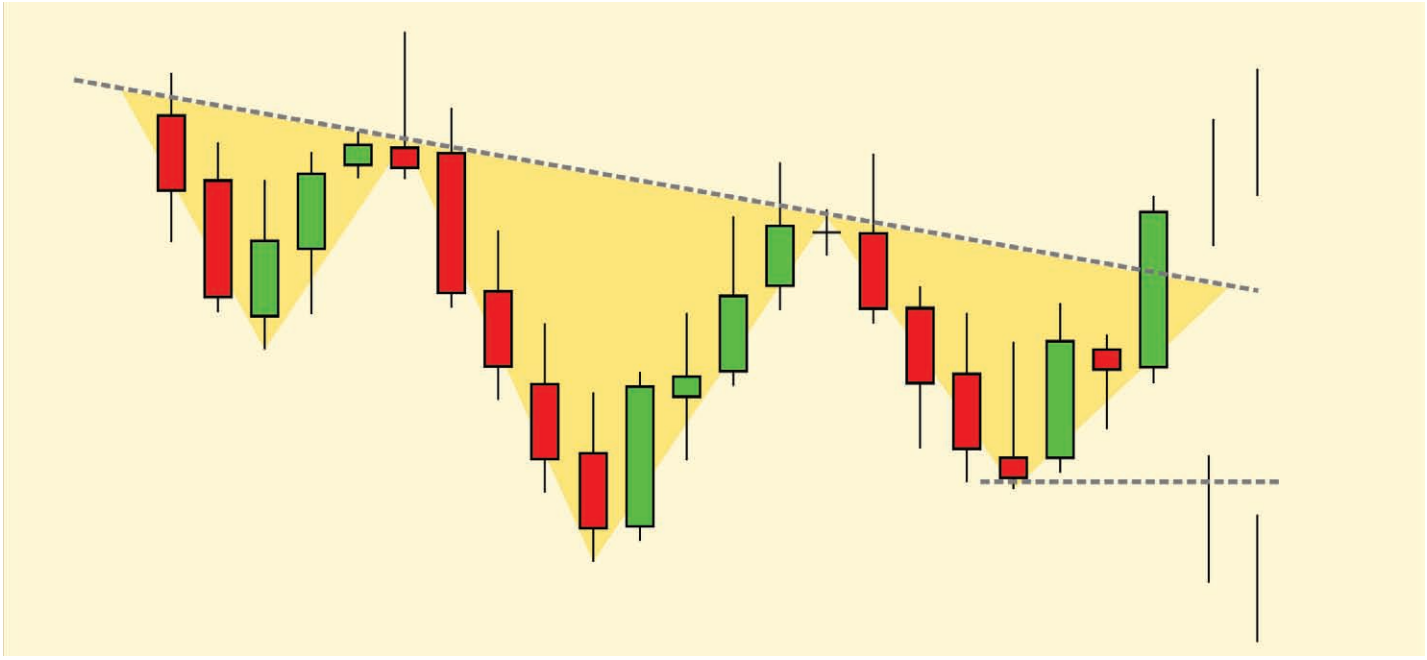
Padrão de: reversão

Alvo: amplitude do fundo da cabeça a linha de pescoço projetada a partir do ponto do rompimento

Incidência de pullback: 50% dos casos

A formação de OCO invertido é menos conhecida dos traders em geral. É a versão altista do padrão de OCO que conhecemos. É caracterizada, portanto, por três fundos. O segundo fundo é mais baixo que o primeiro, e o terceiro é mais alto que o segundo. Formamos com esses fundos a mesma figura de um OCO normal, porém invertida. Esse padrão é mais raro de visualizar do que o OCO normal. E isso não se deve ao fato de não procurarmos por ele. De fato, é mais raro.

Atenção! O OCOi é um padrão muito conhecido, e por isso, gera fortes posicionamentos mesmo antes do seu acionamento. Caso o segundo ombro seja rompido contra a direção que indica o padrão, mesmo antes de seu acionamento, isso fará com que muitos trades tenham que fechar posições. Por isso, essa frustração costuma gerar fortes movimentos e portanto, deve ser operada.



Setups

Ombro cabeça ombro (OCO)

Padrão de: reversão

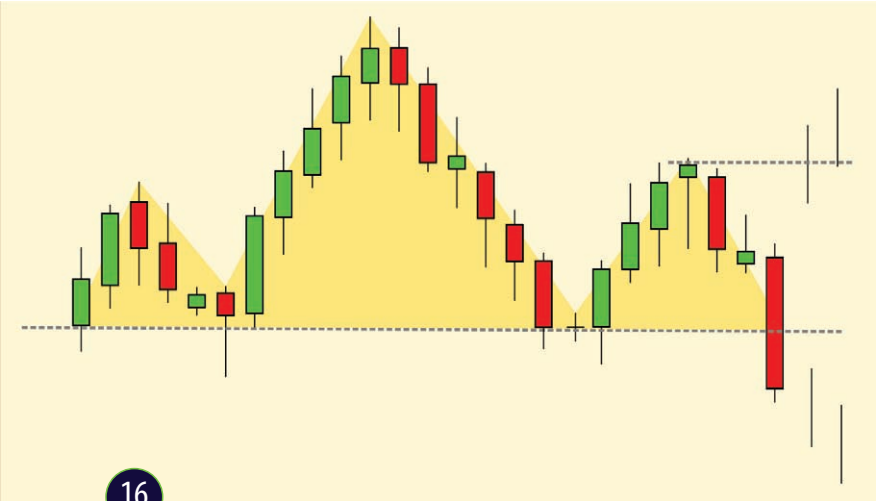
Alvo: amplitude do topo da cabeça a linha de pescoço projetada a partir do rompimento

Incidência de pullback: 50% dos casos

O oco é um padrão de reversão bastante importante, sendo formado por três topos. O segundo topo é mais alto que o primeiro, e o terceiro topo é mais baixo que o segundo. A formação toma um aspecto similar a uma figura humana, representando o primeiro topo o ombro direito, o topo central a cabeça, e o último topo o ombro esquerdo. O fundo formado entre o primeiro e o segundo topo e o fundo formado entre o segundo e o terceiro topo devem ser unidos como uma linha, chamada linha de pescoço. Na maior parte das vezes essa linha apresentará uma leve inclinação altista - a baixista também é possível, mas raramente acontece.

A principal característica desse padrão é a simetria. Existe um eixo simétrico vertical, que parte do topo da cabeça e faz um lado do padrão ser espelhado pelo outro. Não é incomum o eixo de simetria também apresentar uma inclinação. Tente identificá-la pelo desnível que o terceiro topo demonstra em relação ao primeiro. Essa característica simetria permite, portanto, que tenhamos OCOs que apresentam dois ombros de um lado, desde que isso seja espelhado no outro. O acionamento do padrão se dá com o rompimento da linha de pescoço.

Atenção! O OCO é um padrão muito conhecido, e por isso, gera fortes posicionamentos mesmo antes do seu acionamento. Caso o segundo ombro seja rompido contra a direção que indica o padrão, mesmo antes de seu acionamento, isso fará com que muitos trades tenham que fechar posições. Por isso, essa frustração costuma gerar fortes movimentos e portanto, deve ser operada.



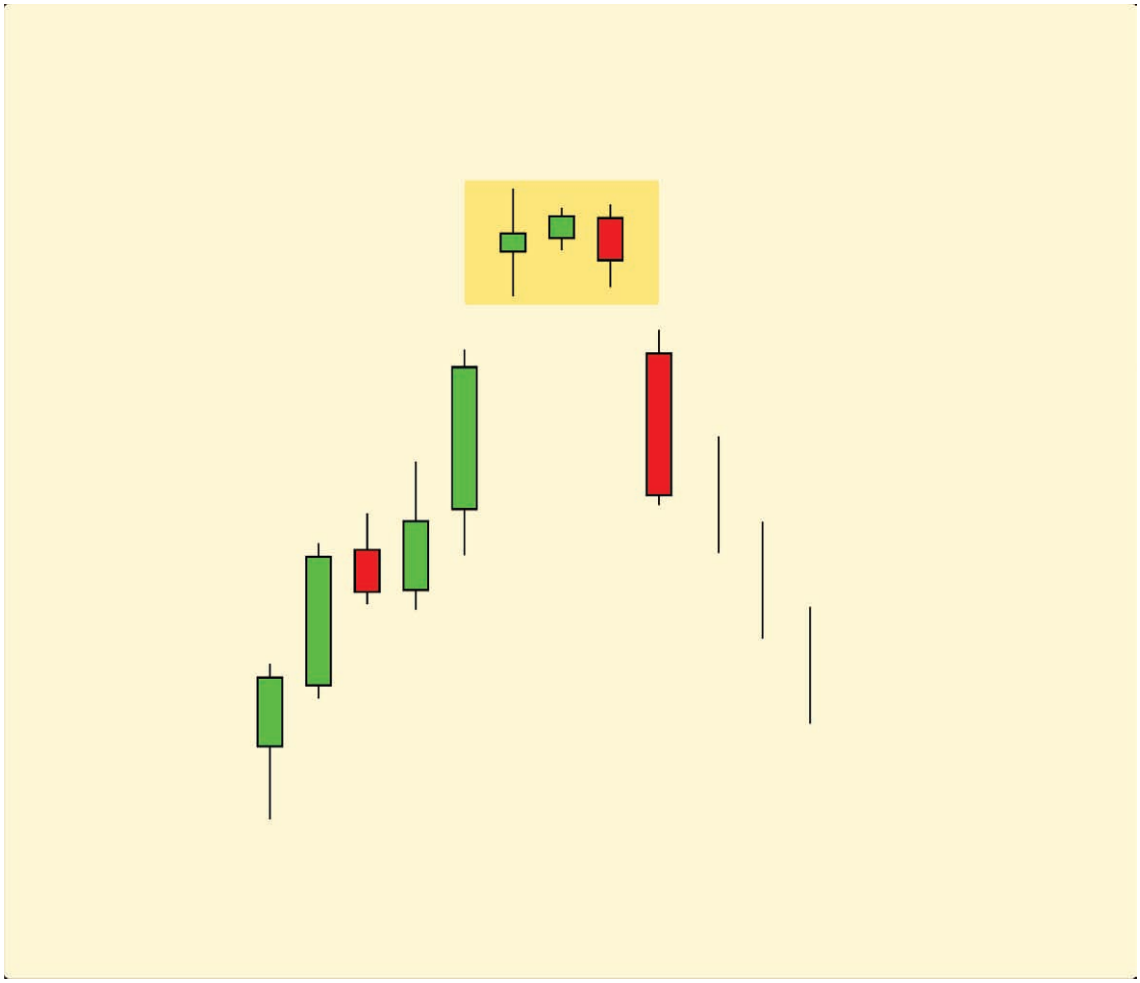
Ilha de reversão

Padrão de: continuação/reversão

Alvo: amplitude do suporte a resistência projetada a partir do ponto do rompimento

Incidência de pullback: Não se aplica

A ilha de reversão pode ser definida como uma pequena consolidação iniciada após um gap de exaustão e rompida com um gap de fuga contrário à direção do movimento prévio. Assim, a pequena consolidação é deixada totalmente isolada do restante do gráfico, exatamente como uma ilha em relação ao continente. É um padrão de reversão forte quando aparece depois de um longo movimento direcional. Observe que a ilha de reversão, quando transportada para a periodicidade maior, se transforme num bebê abandonado rompido em gap.

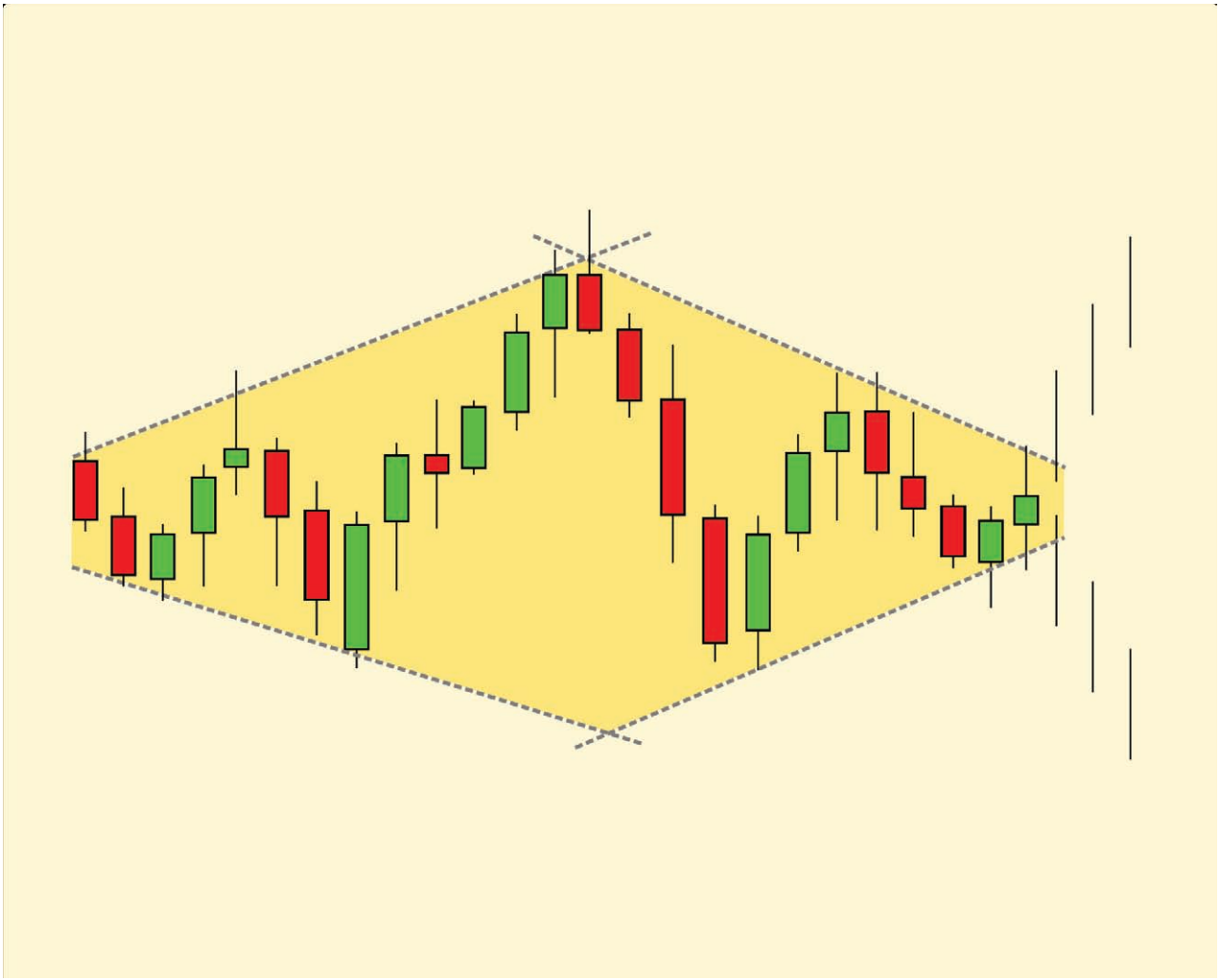


Diamante

Padrão de: reversão

Alvo: amplitude do fundo ao topo projetada a partir do ponto do rompimento

Comumente, esse padrão acontece depois de uma movimentação prévia altista, sendo portanto, um padrão que inicia um movimento baixista. Sua configuração lembra um oco que tem a linha de pescoço em “V”. Uma outra percepção seria um alargamento do lado esquerdo (expansão do movimento) e seu formato espelhado do lado direito (também pode ser visto como um triângulo simétrico – contração do movimento). O acionamento do padrão se dá nos rompimentos da LTA inferior em reversões baixista, e na LTB superior nas reversões altistas.



SETUPS

MÉTODO BISI DE DAYTRADE

Método Bisi de Daytrade

Resumo

O método Bisi de daytrade é um modelo que utiliza conceitos clássicos de análise gráfica, mas que é pautado por setups. Setups são formações específicas de preço, mas que variam muito em detalhes e contexto. O modelo busca alinhar a melhor relação entre os setups e o contexto de mercado, sendo subjetivo na análise e discricionário na tomada de decisão. Dessa forma, é um modelo de baixa frequência de trades. Na base de 1 a 3 por pregão usualmente. São utilizados os gráficos de 15 minutos como base e os de 60 e 5 minutos como acessórios.

Entrada

Entradas são feitas sempre na base da confirmação ou acionamento da barra que oferece o sinal. Caso o preço se afaste bastante do preço de acionamento, a intenção de realizar o trade é abortada.

Stop

O stop de entrada é automático e depende do setup, mas costuma ser relativamente longo no início. Geralmente além de um topo ou fundo. Frequentemente se utiliza um ajuste fino de posicionamento de stop buscando uma distância mínima equivalente a 20% da média da volatilidade histórica (MVH) do ativo e números redondos.

Além do stop de entrada e independente de qualquer alvo ter sido atingido, utiliza-se um stop móvel que tem como base o rompimento confirmado da média móvel exponencial de 9 períodos (mme9).

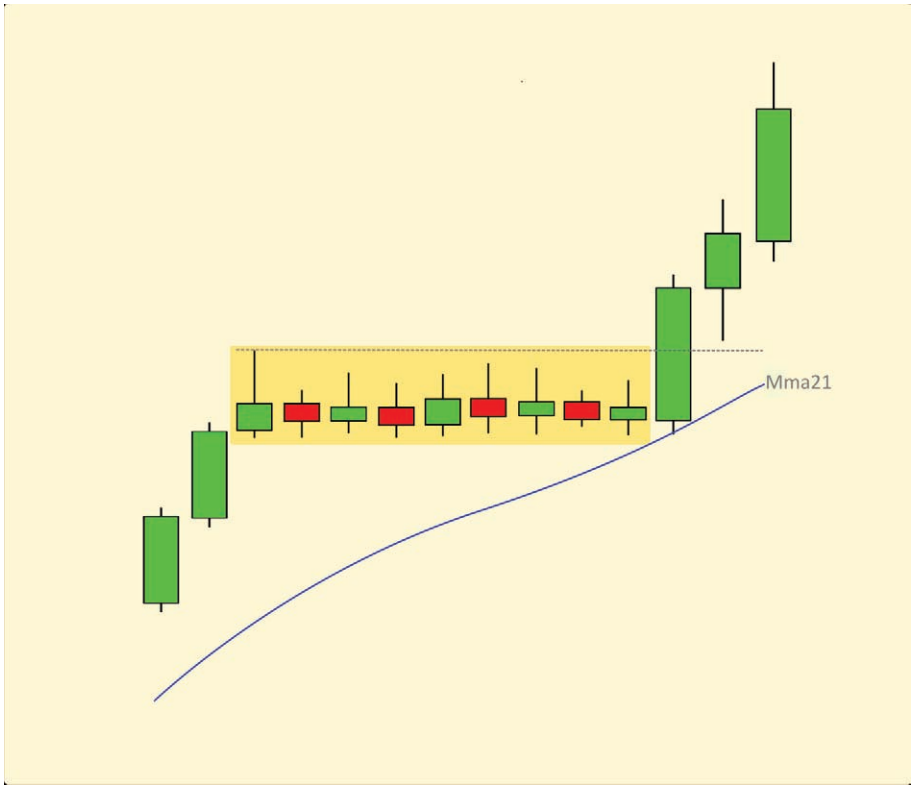
Alvo e manejo de posição

Usualmente, se utiliza apenas uma saída para encerrar a posição. Mas é aceitável no modelo utilizar o alvo da operação para realizar parcial (redução) e carregar o restante da posição pelo stop móvel da mme9.

Via de regra, utiliza-se para definir o alvo da operação um ganho equivalente a 20% da média da volatilidade histórica projetada a partir do preço de entrada. Por exemplo, se a volatilidade histórica é de 8,5%, o alvo deve equivaler a um ganho de 1,70%. Mas o alvo está sujeito a ajustes dados pela sensibilidade do trader.

Power Breakout

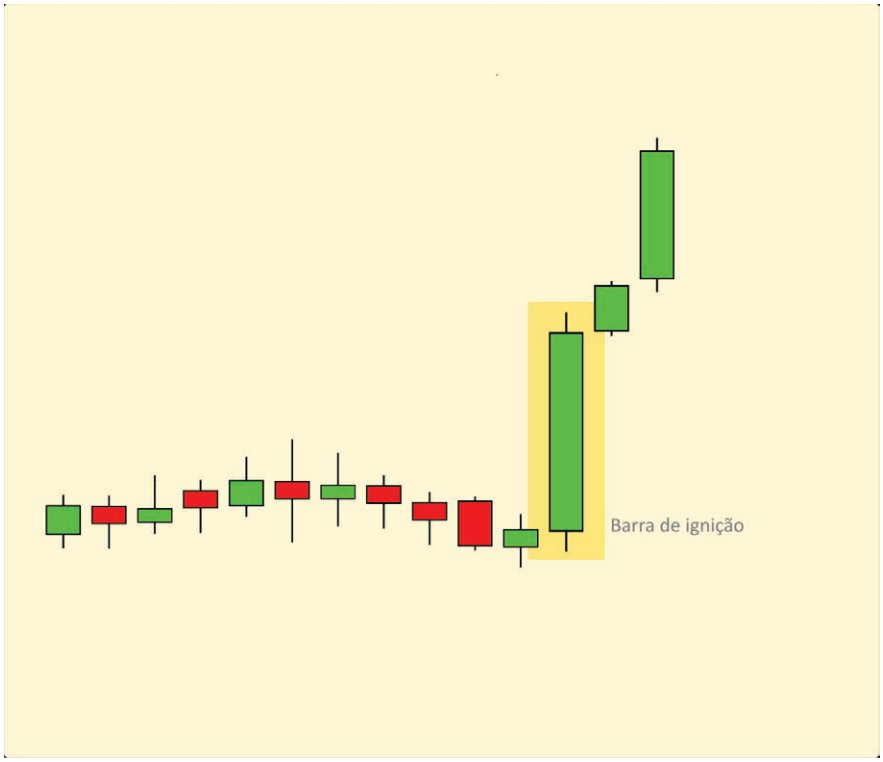
É um tipo específico de rompimento de consolidação. Inicialmente, o preço evolui direcionalmente em um ritmo forte, se afastando da mma21 até que cessa o movimento e começa a corrigir. A característica dessa correção é ser lateral com progressiva perda de amplitude, ficando cada vez mais estreita (a correção deve apresentar pelo menos 10 candles). Conforme a mma21 se aproxima novamente dos preços, o padrão fica cada vez mais propenso ao rompimento na direção do movimento prévio. Em cenários ideais, pode-se trabalhar a operação por violação tendo como referência o extremo dos últimos 2/3 de consolidação. Mas via de regra se opera por rompimento confirmado.



Barra de ignição (BI)

A barra de ignição é uma barra de força que surge de maneira abrupta no gráfico e que “quebra” com o padrão de movimento que o ativo vinha exibindo até então. Essa quebra de padrão passa a ideia de que o movimento vigente se encerrou e um novo surge na direção da barra de ignição. É caracterizada por uma barra de pouca ou nenhuma sombra e de corpo claramente maior que o corpo dos candles anteriores. Uma boa barra de ignição fecha muito próxima do seu extremo e apresenta alto volume.

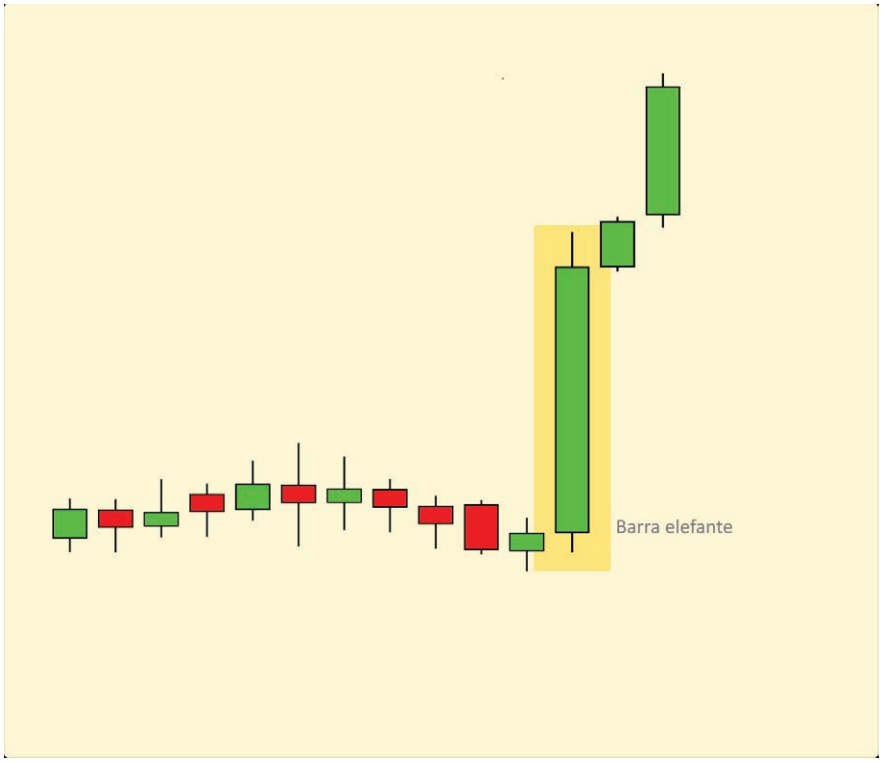
Se opera no acionamento da barra de ignição.



Barra Elefante (BE ou Ebar)

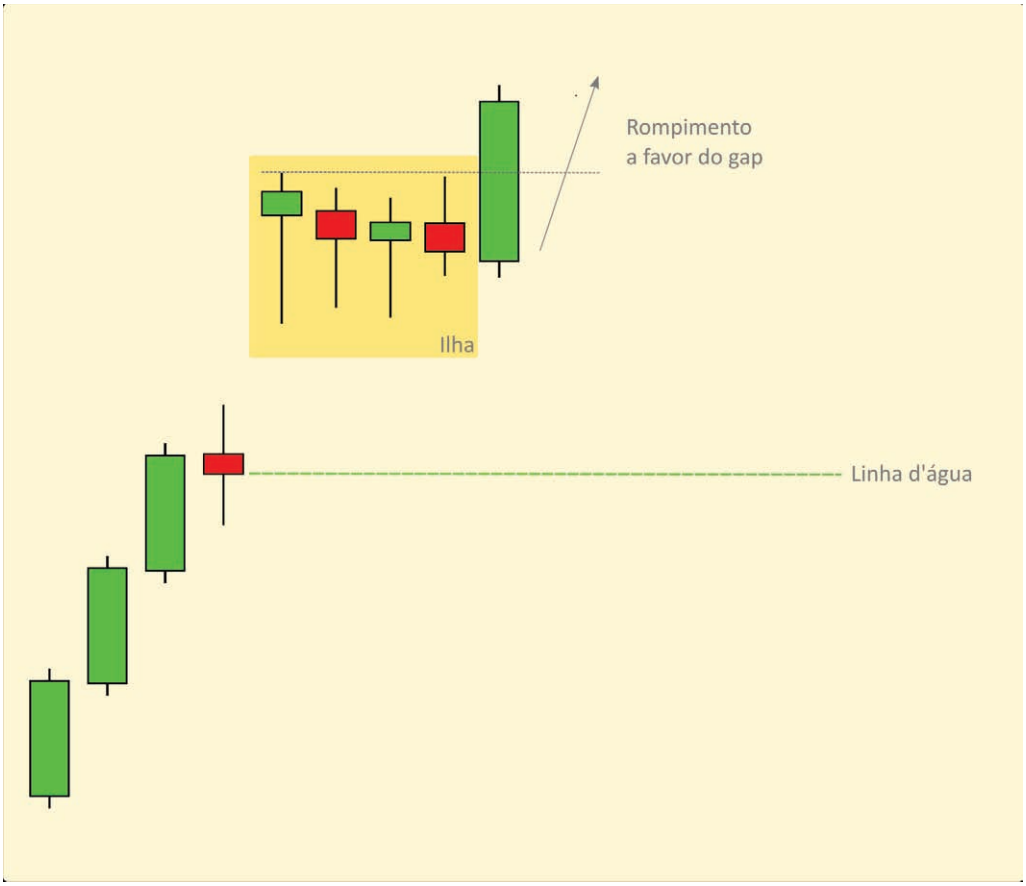
É um caso específico de barra de ignição, exibindo exatamente as mesmas características com apenas uma diferença: a amplitude da barra elefante é muito maior do que a amplitude dos candles anteriores. Essas barras são mais comuns próximas da abertura do pregão.

Na prática, não há muita diferença entre uma barra elefante e uma barra de ignição. Devido a sua amplitude, a barra elefante é bem mais óbvia do que uma barra de ignição, sendo mais fácil identificá-la. No entanto, o stop no extremo contrário da barra tende a ser caro (deve-se buscar por oportunidades onde o acionamento não fique demasiadamente distante da mma21).



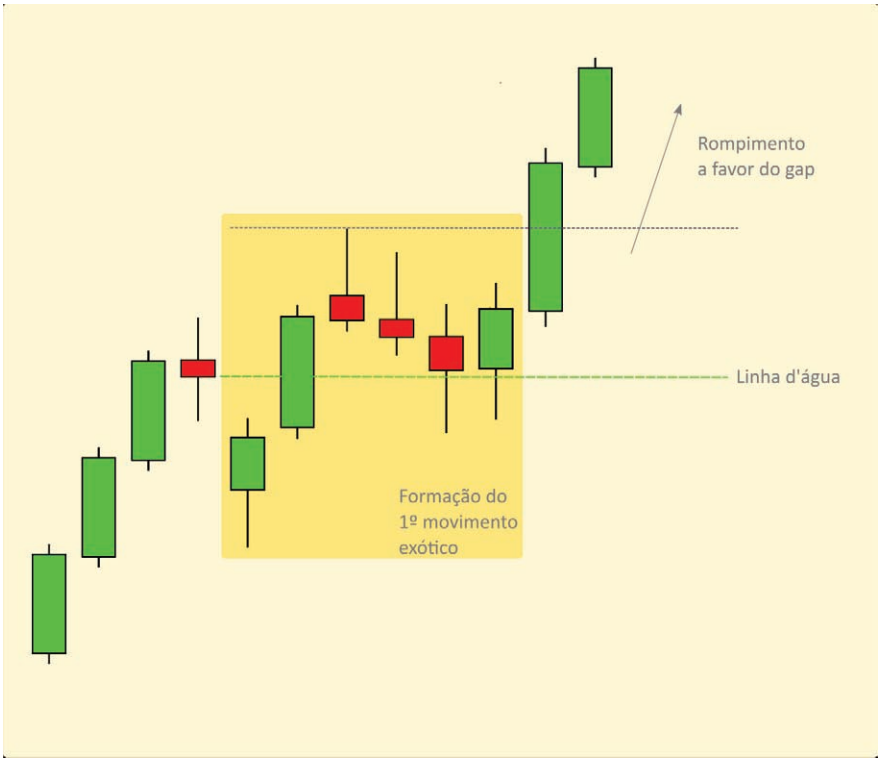
Ilha

A ilha é um tipo especifico de primeiro movimento onde após a abertura em gap, o preço oscila lateralmente. Difere da forma lateral típica de primeiro movimento por ser um movimento caracterizado por candles lado a lado, sem dar ideia de ziguezague. Para que o padrão se torne claro, é necessário ocorrer pelo menos 4 candles laterais sem que o preço acelere e desconfigure o padrão. Com essa condição cumprida, opera-se o rompimento da formação na direção favorável ao gap. A ilha, nas condições ideais, pode ser operada na violação ao invés do rompimento.



1º movimento exótico

Este setup é uma versão específica e menos frequente de primeiro movimento.Ocorre quando a abertura é em gap, mas de imediato o primeiro movimento que surge vai na direção contrária do gap, fechando-o parcialmente ou completamente.O padrão é mais relevante quando surge associado ao rompimento da linha d'água.

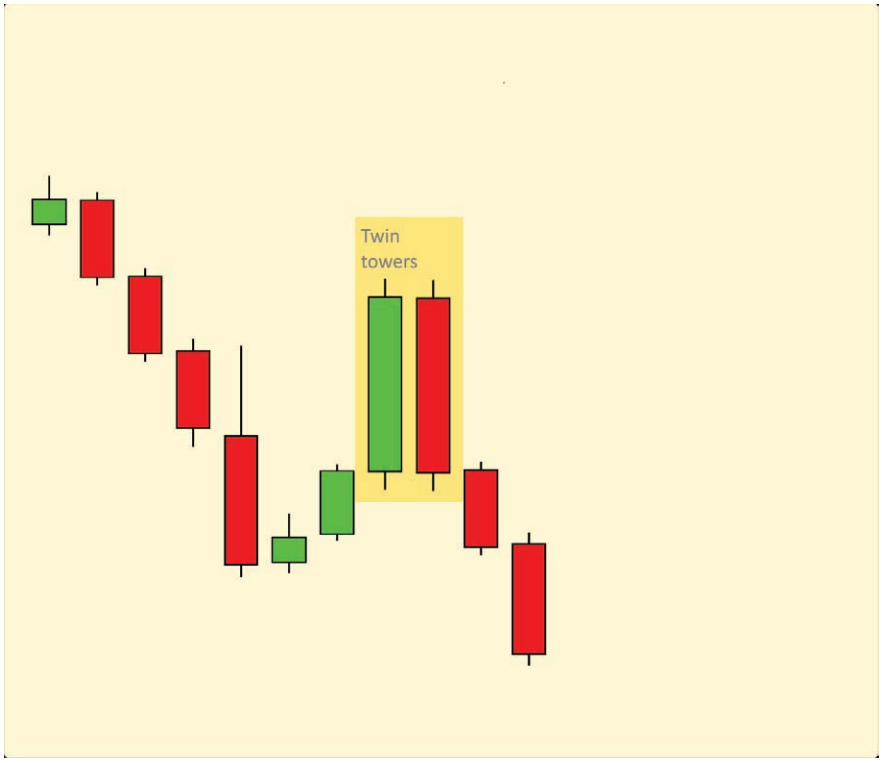


Rompimento

Usualmente se refere a estruturas de suporte ou resistência que possuem vários testes e que não se enquadram nos setups específicos. Boas estruturas rompidas costumar ter pelo menos dois testes prévios (idealmente, ao menos 1 teste no pregão vigente) em zonas importantes de preços; também, o candle que produziu o rompimento deve ser amplo e com bom volume..

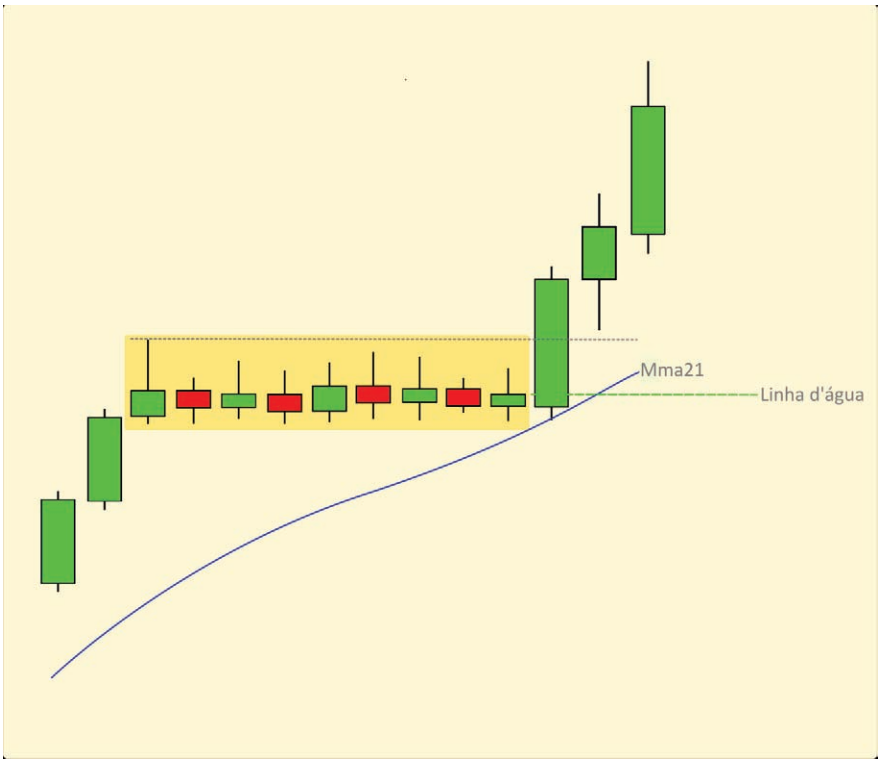
Twin Towers

Quando o mercado gera um candle forte para um lado (gerando uma barra de ignição), e no candle seguinte nega esse sinal com uma barra tão forte quanto na direção oposta. A amplitude do corpo da segunda barra deve ser igual ou maior do que a da primeira. O volume sendo maior na segunda barra, reforça bastante a ideia de reversão (mas não é um pré-requisito). O padrão é forte quando ocorre na tentativa de rompimento de um ponto importante para os preços ou a favor de uma tendência forte, frustrando uma tentativa de reação.



Opening power breakout

É um setup específico de power breakout que tem seu acionamento no início do pregão, mas com sua formação pertencente ao pregão anterior. Costuma ser rápido e por isso é melhor trabalhar na violação da máxima da consolidação para operaçãoes long (compra), e da mínima para operações short (vendas).



Setups

Linha d’água(LD)

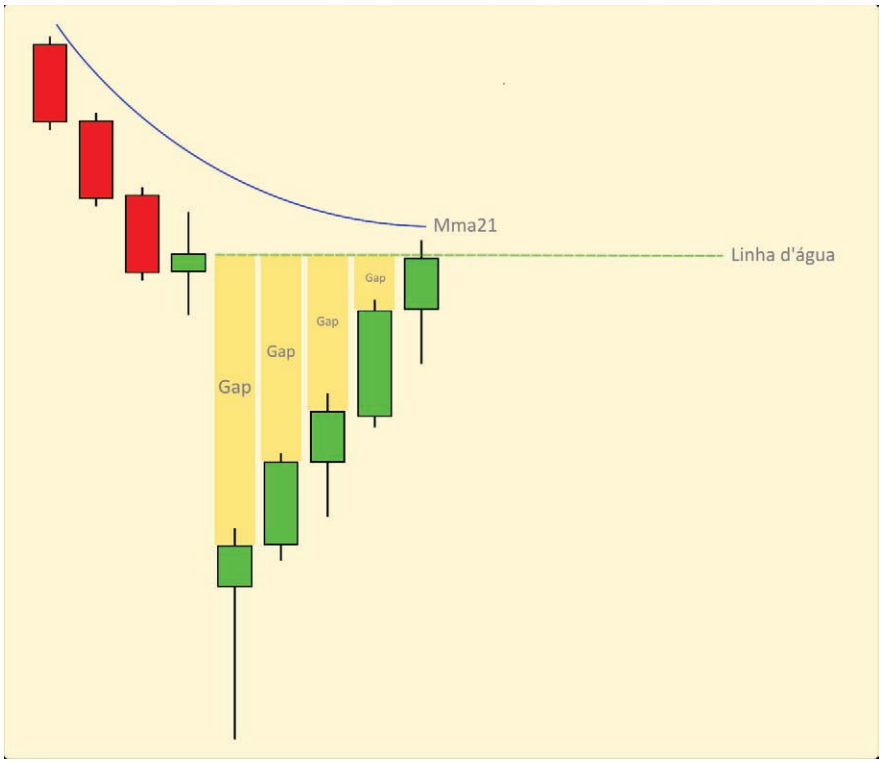
A estrutura denominada como linha d´água é o preço de fechamento do ativo no pregão anterior (não se considera o aftermarket no caso de ações nem o preço de ajuste no caso de futuros). Este preço será a fronteira entre a variação positiva e a negativa para o ativo. Acima da linha d’água temos variação positiva, abaixo, negativa

A linha d'água é muito significativa e efetiva em pregões que abrem em gap. Quando a abertura se dá "morna" (em cima da linha d'água), sugere que não há força dominante no pregão corrente e assim, há uma menor probabilidade desse patamar ser defendido e oferecer oportunidades.

Fechamento de gap

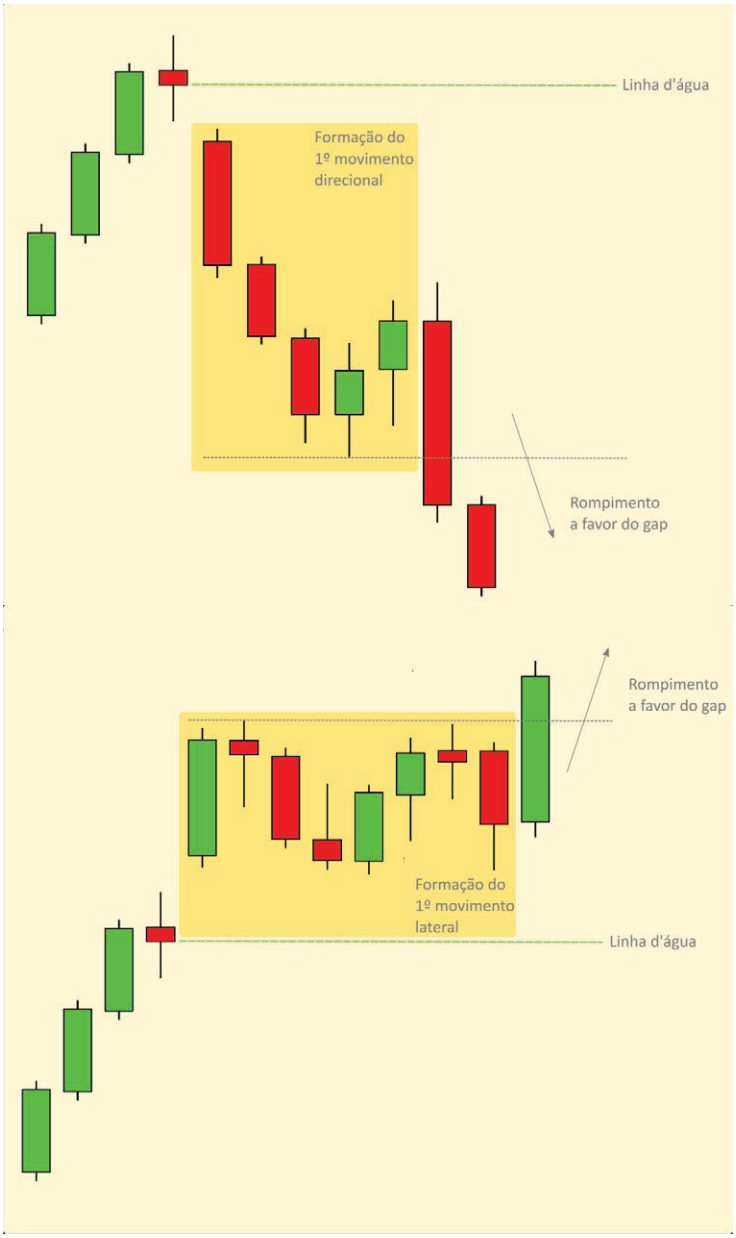
Ocorre quando o ativo abre em gap de boa amplitude e o primeiro candle fechado passa uma mensagem oposta ao gap, ou seja, o candle que se forma é um candle de força contrária; ou de reversão em relação ao gap. O candle do sinal deve ser amplo. Opera-se o acionamento deste candle tendo como objetivo usualmente a metade da amplitude do gap. O acionamento tem que ocorrer logo, caso contrário começa a se consolidar um setup de ilha ou primeiro movimento. Gaps muito grandes são mais perigosos, pois dificilmente são fechados. Sua retração, quando ocorre, costuma ficar mais próxima da proporção de um terço.

Apesar de ser um padrão fácil de identificar, exige sensibilidade para identificar quando realmente vale a pena operá-lo.



1º movimento

Podemos descrevê-lo de forma simplista como sendo o primeiro ziguezague do preço após a abertura. Geralmente, com a abertura temos um movimento direcional de 2, 3 ou mais candles e depois um movimento contrário, marcando um primeiro movimento com início (abertura) e fim (início de correção) formando um ponto de inflexão (topo ou fundo). O setup é caracterizado pelo rompimento confirmado desse primeiro topo ou fundo formado pelo primeiro movimento dos preços.

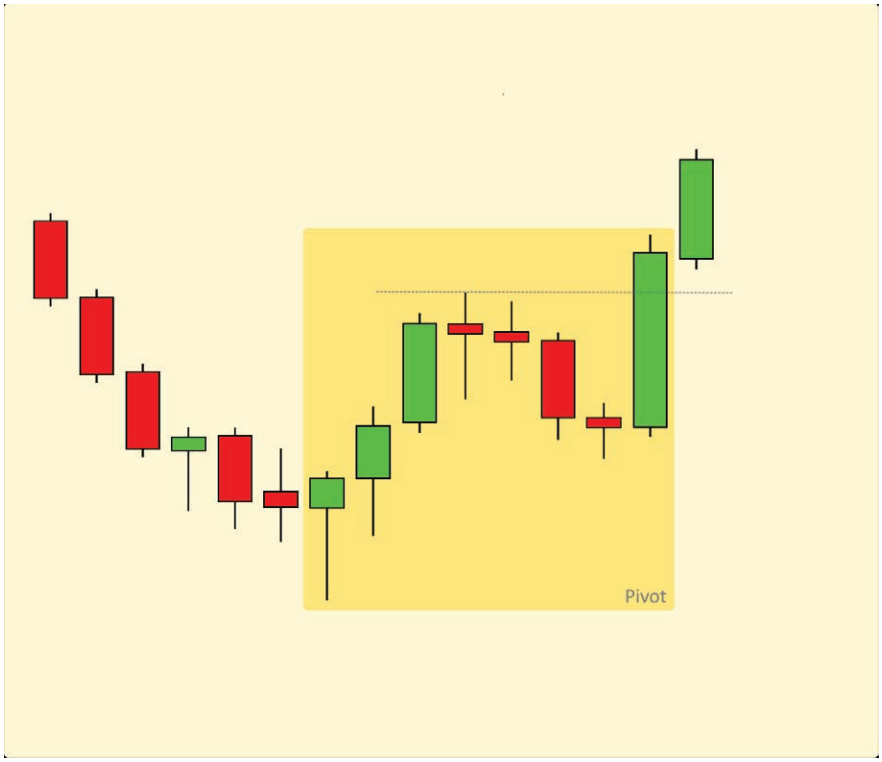


O padrão ganha relevância quando a abertura ocorre em gap e é respeitado pela correção necessária para formar o primeiro topo ou fundo. Melhor ainda, caso o gap nem venha a ser testado na correção. Importante: não se opera na direção contrário do gap.

O primeiro movimento pode exibir diversas formas. As duas mais usuais são a forma direcional e a lateral. Repare que na imagem de cima existe um pequeno rali nos preços antes da marcação do primeiro topo ou fundo. Nesses casos é importante que a correção que se segue não se aprofunde até a abertura. Já na segunda figura, o movimento é lateral, similar a uma congestão. É importante salientar que ambas as formas são igualmente eficazes.

Pivot

É a configuração que quebra a direção descendente (ou indefinida) de mercado. Isto se dá pelo rompimento do topo produzido pela formação dos dois primeiros fundos ascendentes (ou no mesmo nível). Simplificando: é o primeiro zigue-zague de alta no mercado.

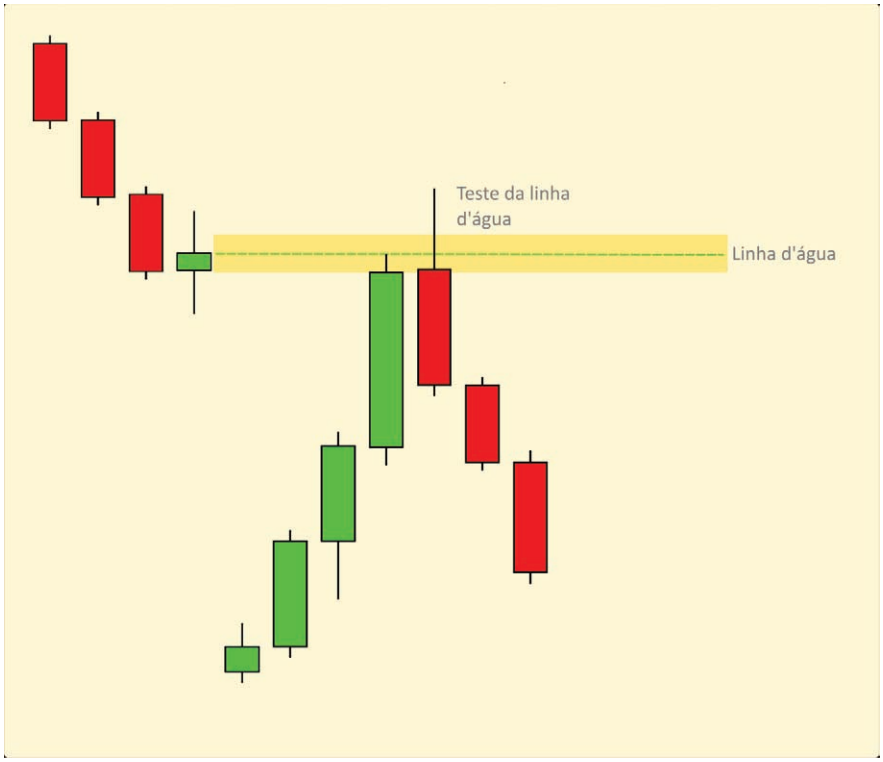


Teste de linha d’água (TLD)

Por marcar um ponto de transição entre força dominante compradora e vendedora, a linha d´água é defendida pela força dominante vigente. Em um ativo que opera acima da linha d’água, será defendido pelos compradores, tornando-se suporte. Em um ativo que opera abaixo da linha d’água, será defendido pelos vendedores transformando-se em resistência.

É possível utilizar esse conhecimento para operar o teste da linha d’água, na expectativa que ela resista ao teste e ofereça um repique nos preços. Costuma ser mais atraente quando o teste resulta numa oportunidade a favor do viés, com boa amplitude do movimento prévio e com candle forte de reversão.

Se opera no acionamento do candle que indica a frustração da tentativa de rompimento.



Retorno à média (RaM) ou contra-tendência (CT)

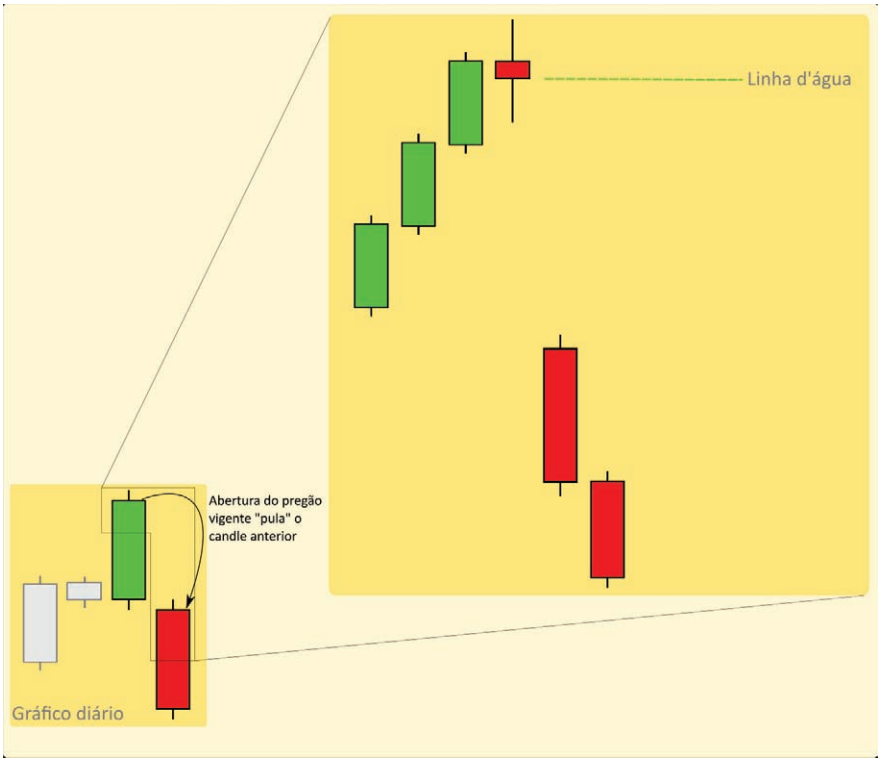
São cenários onde o preço se afasta demais da mma21 (média móvel aritmética de 21 períodos) em um ritmo acelerado, ficando sobre-comprado ou sobre-vendido. O “quanto” o mercado deve se afastar é subjetivo e é nisso que reside o perigo de se buscar esse setup. É tentador buscar um trade de retorno a média, mas são poucos os sinais que realmente são consistentes e, portanto, operáveis.

Bons trades de retorno a média ocorrem no final da primeira parte do pregão, geralmente a partir das 12h00 (antes disso tendem a produzir sinais falsos). Um bom sinal ocorre com candle de reversão de boa amplitude e com alto volume. Busque por reversões em cima de estruturas de preço (suporte ou resistência) conhecidas, idealmente visíveis no gráfico de 60 minutos.

Monster gap

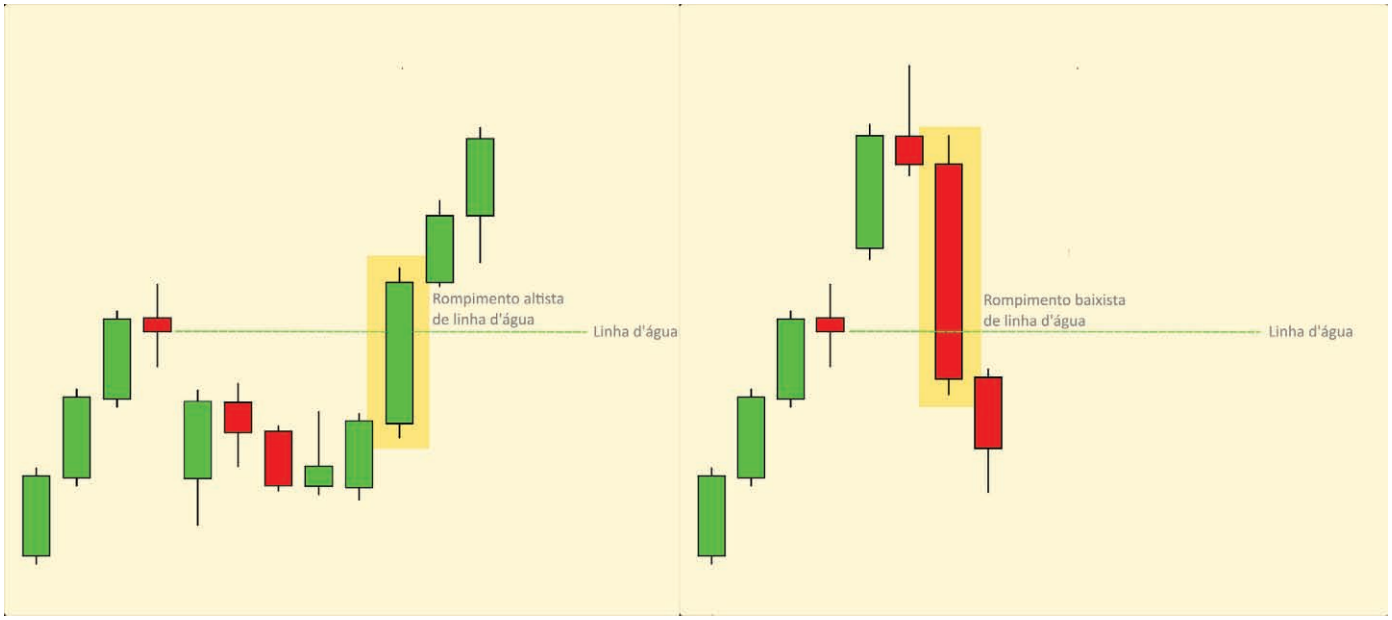
Apesar de ser um padrão para ser operado em prazos intradiários, o monster gap é mais fácil de ser identificado na periodicidade diária. Ele ocorre quando no pregão anterior temos uma barra diária de força, indicando a continuidade do movimento, porém a abertura do candle seguinte se dá em um gap significativo, mas na direção contrária.

Essa abertura em gap deve idealmente “pular” o candle prévio, ignorando-o completamente. Contudo, aceita-se aberturas menos intensas, pelo menos “pulando” a metade da barra prévia. Feita a identificação do padrão na periodicidade diária, opera-se no intraday com a violação do extremo da primeira barra de 15 minutos na direção favorável ao gap.



Rompimento de linha d'água

Principalmente em pregões onde há a abertura em gap, costuma ser difícil para o preço romper a linha d'água para o lado oposto da abertura. Por marcar um ponto de transição entre força dominante compradora e vendedora, a linha d´água costuma ser defendida pela força vigente. No entanto, quando esse rompimento de fato ocorre, a transição tende a ser permanente para o pregão, marcando uma virada da força dominante e, portanto, também sugerindo um provável avanço na direção do rompimento.

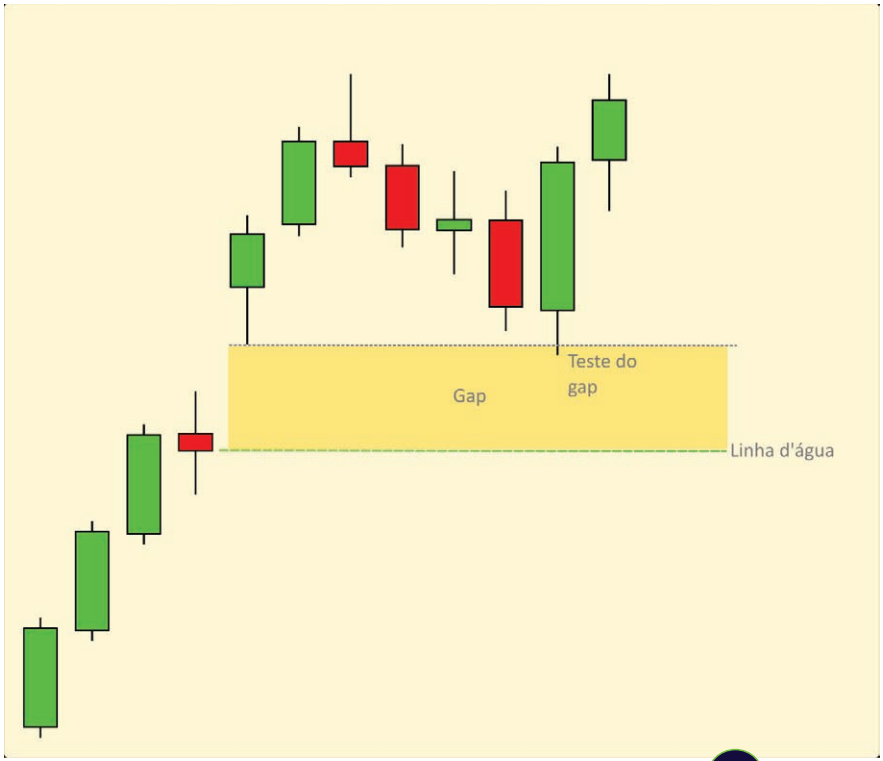


Teste de gap

Gaps têm a propriedade de criar zonas importante de suporte ou resistência, especialmente quando os preços aceleram direcionalmente após o gap. Esse é um cenário típico do padrão de primeiro movimento. O teste de suporte/resistência de gap ocorre quando a correção do primeiro movimento é extensa, vindo buscar a abertura do gap.

Neste setup, o mercado abre em gap e avança na direção deste por alguns candles até iniciar uma correção que indica o final do primeiro movimento - usualmente a correção é apenas parcial. Mas quando a correção é mais forte, tende-se a buscar a abertura em gap como alvo. Caso isso ocorra, é normal que o preço repique após o teste da abertura, gerando uma oportunidade de operação a qual chamamos de teste de gap.

O setup encaixa bem para situações onde esperar pelo rompimento do primeiro movimento pode tornar a entrada cara demais, principalmente pelo motivo do gap de abertura ter sido extenso. No caso da correção, o ideal é que o teste da estrutura do gap seja o primeiro e sem um movimento de ziguezague. Se o teste do suporte/resistência da abertura em gap se der junto com o teste da mma21, o padrão ganha força.



Rompimento falso

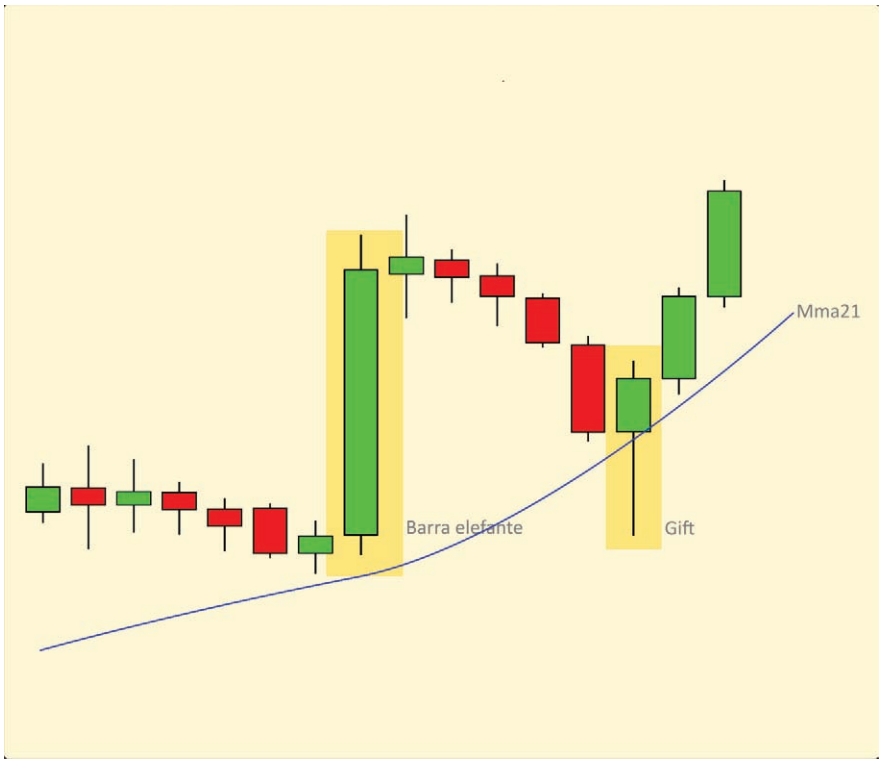
Quando ocorre um rompimento e de imediato esse rompimento é frustrado, o preço costuma evoluir com força na direção contrária à da tentativa de rompimento. Rompimentos falsos funcionam por conta do mesmo princípio de um twin towers: a frustração. Quando mais violenta for a negação do rompimento, melhor será o sinal.

Existem várias formas de rompimentos falsos, mas a mais fácil de identificar é caracterizada por um sinal claro de rompimento que não consegue ter continuidade significativa (se tiver), sofrendo um movimento contrário que tende a acelerar conforme avança. O movimento contrário acaba produzindo o rompimento (não apenas violação) do extremo contrário da barra que tentou o rompimento (extremo onde é usualmente posicionado o stop). A confirmação técnica desse setup ocorre quando o preço dá continuidade à correção e viola a mínima/máxima da última barra.

É importante que a tentativa de rompimento ocorra com alto volume e que o a correção se dê com ainda mais volume. O padrão com frequência pode ser usado na periodicidade menor à padrão. Por exemplo, usar o gráfico de 5 minutos para identificar um rompimento falso e carregar a operação pelo gráfico de 15 minutos.

Gift

O setup de gift ocorre associado a uma barra elefante, sendo especificamente o movimento de correção que eventualmente ocorre dentro dessa mesma barra. É indiferente o fato da barra elefante ter sido acionada ou não, o importante é que caso tenha sido, o movimento favorável a direção da barra elefante não tenha acontecido, dando início a uma correção de 3 ou mais candles para dentro da mesma. No processo de correção, o extremo oposto ao acionamento da barra elefante tem que ser respeitado. Usualmente uma boa oportunidade de gift busca a mma21 ou algo próximo a 50% de correção da barra elefante.



SETUPS

MÉTODO BISI DE SWINGTRADE

Setups

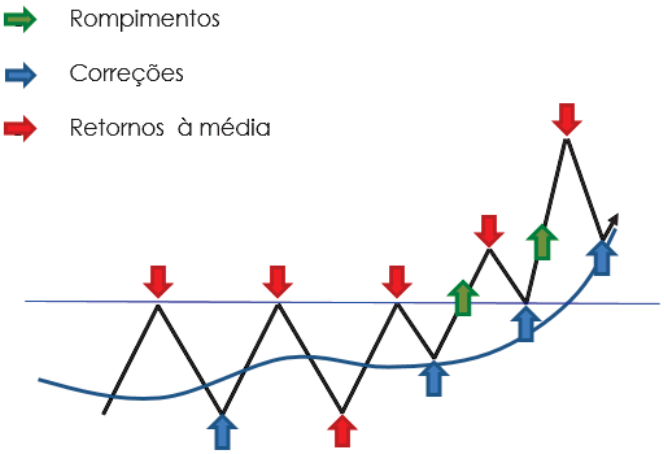
Introdução

Resumo:

O método Bisi de swingtrade é um modelo que utiliza conceitos clássicos de análise gráfica, mas que é pautado por setups. Setups são formações específicas de preço que variam muito em detalhes e contexto. O modelo busca alinhar a melhor relação entre os setups e o cenário de mercado, sendo subjetivo na análise e discricionário na tomada de decisão. Dessa forma, é um modelo de relativa baixa frequência de trades.

As operações geralmente se enquadram em cenários de rompimento, correção ou retorno à média. Existem também operações de momentum (barras de ignição, gap de fuga), mas que podem ser consideradas um tipo de rompimento.

Entradas:



Via de regra, as operações são executadas por acionamento (confirmação do sinal), ocorrendo então sempre na barra seguinte à barra que ofereceu o sinal. Isso ocorre inclusive para rompimentos. Apenas em casos de um sinal muito forte antecipa-se a execução/entrada para dentro da mesma barra que oferece, usualmente próximo do seu fechamento. No caso especifico das recomendações da L&S Análise, mesmo as operações que poderiam ser realizadas dentro da mesma barra, são trabalhadas na barra seguinte. Isso ocorre porque queremos equalizar nossas operações ao usuário que só consegue tomar conhecimento da recomendação após o fechamento do pregão, sendo possível executá-la apenas no pregão seguinte.

Stop:

O stop inicial das operações costuma ficar no extremo contrário da barra que oferece o sinal, usando-se um ajuste fino de valores redondos e buscando ter ao menos uma distância de stop equivalente a 10% da média da volatilidade histórica (MVH) para swing trade. Estes são nortes para o posicionamento do stop, mas não são regras absolutamente rígidas. É comum para o método ter o stop maior do que o alvo (o que se traduz em uma alta taxa de acerto).

Alvo e manejo de posição:

Salvo casos de acionamento do stop de entrada, o método costuma utilizar-se de duas saídas para finalizar a operação: uma no alvo de realização parcial (redução) e a outra através de ajuste de stop, que passa a ser móvel após o primeiro alvo ter sido atingido.

O alvo de realização parcial costuma utilizar 10% da média da volatilidade histórica (MVH) projetada a partir do preço de execução, mas pode ser alterado conforme sensibilidade. Ou seja, se a MVH for de 45,57%, o alvo será de 4,55% a partir do preço de execução. Uma vez atingido o alvo de redução, passa-se a ajustar o stop por mínimas/máximas. As alterações de stop são sempre feitas com o mercado fechado.

Existe também a prática de se fazer um ajuste de stop antes do alvo ser atingido. Isso ocorrerá principalmente quando 80% do alvo tiver sido atingido, ou em outras situações, quando a percepção de risco crescer de forma significativa.

Retorno à média

Operações de retorno a média são operações contra a inclinação da média móvel aritmética de 21 períodos (mma21). Na maior parte das vezes, remetem a cenários de mercado bastante sobre comprado ou sobre vendido. Inclui-se na categoria de retorno a média cenários específicos, usualmente dentro de retângulos, onde operamos contra a média, mas próximos a ela.

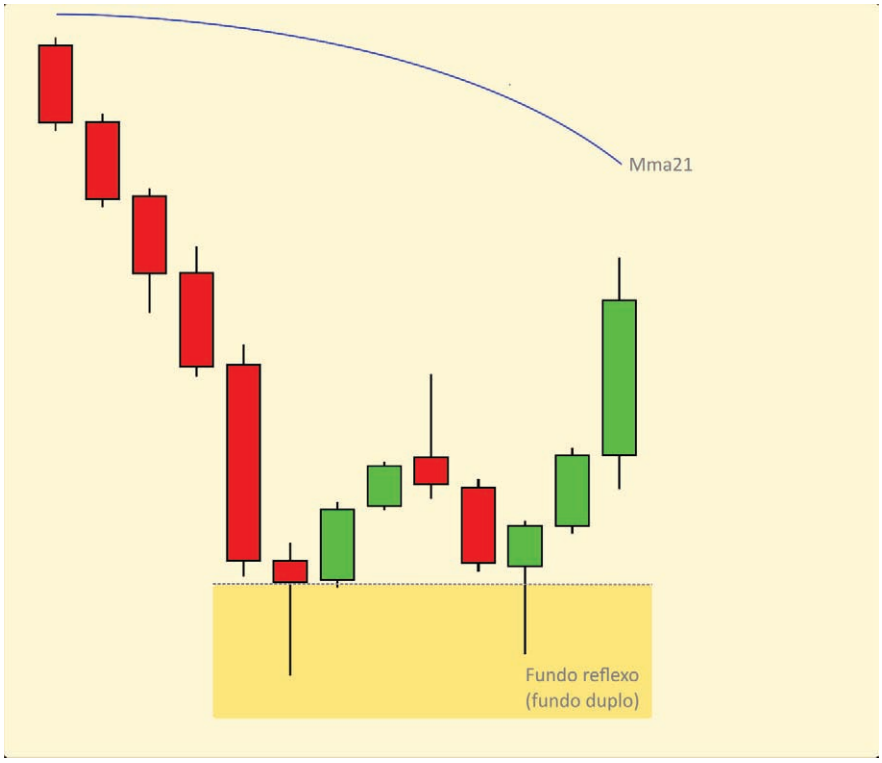
Esse tipo de operação costuma ser mais difícil de acertar, por isso há muito cuidado na seleção das oportunidades. Bons sinais costumam vir de candles amplos, com alto volume, geralmente após movimentos acelerados, fora das bandas de bollinger e com bastante distância para a mma21. Como indicador adicional, pode-se utilizar o índice de afastamento (leandro & stormer volatility index) e buscar por uma leitura idealmente acima de 30.

Dentro do método Bisi, quando a operação não flui para o alvo de forma rápida, costuma-se utilizar um ajuste de stop no tempo, ativado na ocorrência do quarto candle após o sinal de reversão. O ajuste se dá por máximas ou mínimas, dependendo da direção do trade

Fundo reflexo

O fundo reflexo é a versão altista do topo reflexo. Nada mais é do que um tipo específico de retorno à média que se torna mais comum de tempos em tempos. O padrão é caracterizado por uma formação de breve fundo duplo, mantendo ainda uma boa distância em relação a mma21.

Neste padrão, o preço aciona um sinal de reversão marcando um fundo, ameaça fluir, mas o preço acaba por voltar a cair, usualmente transitando abaixo do sinal de reversão (e talvez gerando stop para quem entrou). Mas logo que estressa essa zona de stop, surge um novo sinal de reversão - esse é o fundo reflexo. Idealmente, o volume deve ser maior no segundo sinal.



Setups

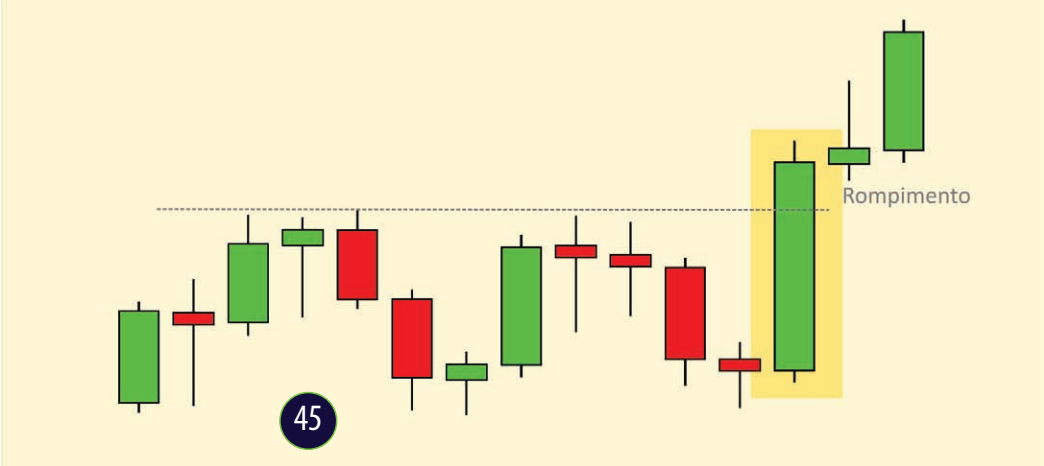
Rompimento

O rompimento é o argumento de trade mais frequente do modelo. Rompimentos podem se apresentar de várias formas, rompendo diferentes tipos de estruturas de resistência ou suportes. Usualmente são rompimentos de congestões, consolidações ou de estruturas definidas por pelo menos dois testes em momentos distintos.

O rompimento ocorre quando uma estrutura de preço (suporte ou resistência) é ultrapassada em fechamento de candle. O rompimento ideal ocorre com volume acima da média e com uma barra de força. Prefere-se cenários onde não há obstáculos imediatos ao trade, seja por estrutura de preço ou por médias móveis contrárias. Rompimentos que ocorrem com preço esticado, distante da mma21, ou vindo de uma sequência já significativa de candles direcionais, devem ser evitados.

Em análise gráfica, classicamente, a operação de rompimento costuma ser executada perto do encerramento da barra que gera o sinal. As operações classificadas como "rompimento" dentro do M. Bisi se referem a cenários exatamente como esse. No entanto, seguindo a premissa do nosso modelo de recomendações, deixamos a execução para o pregão seguinte. Isso significa que no pregão seguinte a operação está autorizada, não necessitando de confirmações. Basta que no pregão seguinte o preço não abra demasiadamente contra (o que poderia configurar um monster gap) ou muito além do preço máximo estipulado. O intervalo executável de preço consta no planejamento da recomendação.

Quando uma operação é classificada como "rompimento confirmado", significa que esta operação necessita de acionamento, sendo este a superação da máxima para compras ou da mínima para vendas. Este tipo é o mais frequente dentro das recomendações..



Rompimento confirmado

Nada mais é do que uma operação de rompimento onde se exige uma confirmação para se executar a operação. A confirmação se dá sempre no próximo pregão e, dependendo do cenário, pode ser prorrogável para outro pregão (no caso de “barras ignoradas” formadas por candles pequenos). A confirmação de um rompimento altista é a superação da máxima da barra que rompeu. De forma análoga, a confirmação de um rompimento baixista é a perda da mínima da barra que rompeu.

É justo dizer que o rompimento confirmado acabou se tornando a forma padrão de executar um rompimento. Deixa-se de lado a confirmação em cenários onde há muita confiança no rompimento, fazendo com que uma abertura contrária seja vista mais como oportunidade do que como risco de falha; ou em casos onde junto com uma boa dose de confiança na operação, há uma sombra que tornaria cara a confirmação em relação ao preço de fechamento.

Gap de fuga

O gap de fuga é uma barra que surge em gap e que no contexto dá a ideia de que o movimento terá continuidade na direção do gap. É comumente associado a um rompimento, mas pode também aparecer em outras configurações, especialmente deixando para trás um movimento arrastado de correção. De qualquer forma, mantem-se a classificação de gap de fuga por ser mais forte. Opera-se na direção no gap através da confirmação da barra.

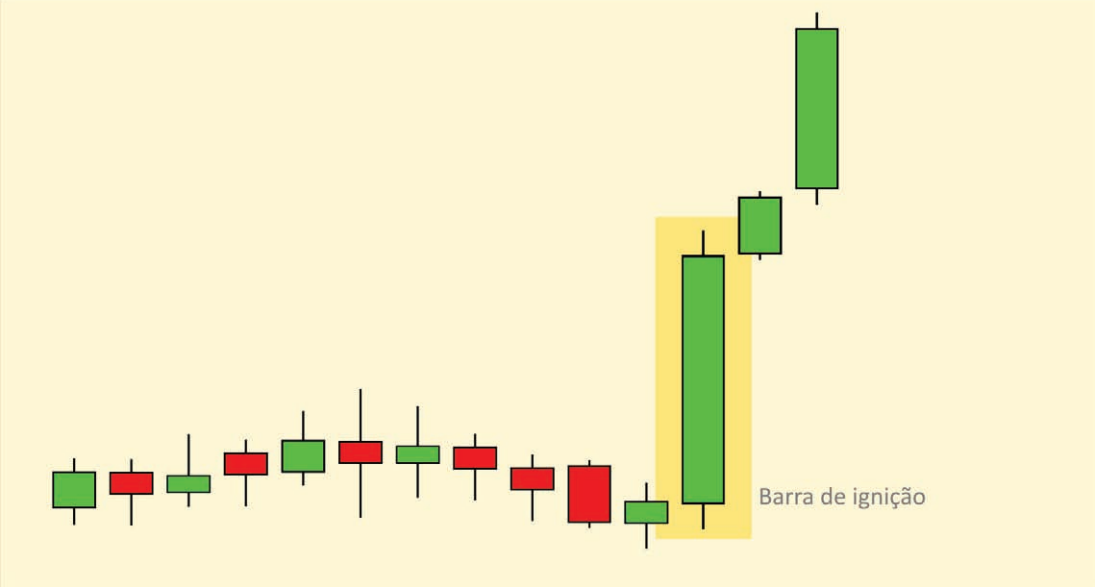
Na análise gráfica clássica, classificam-se os gaps em quatro tipos: de área, de fuga, de medida e de exaustão. Essa classificação tem a ver com onde o gap surge em relação ao tipo de movimento presente no gráfico. O gap de fuga do setup M. Bisi ST não faz essa distinção apesar de entender a diferença entre as classificações. Um gap de fuga do modelo pode ser classificado das quatro formas. O importante é a percepção de que do ponto de execução em diante provavelmente se conseguirá buscar movimento suficiente para fazer com que a operação seja lucrativa.

Barra de ignição

A barra de ignição é uma barra de força que surge de maneira abrupta no gráfico e que “quebra” com o padrão de movimento que o ativo vinha exibindo até então. Essa quebra de padrão passa a ideia de que o movimento vigente se encerrou e um novo surge na direção da barra de ignição. Não há necessariamente o rompimento de uma estrutura, mas costuma haver o rompimento de várias máximas/mínimas prévias.

É caracterizada por uma barra de pouca ou nenhuma sombra e de corpo claramente maior que o corpo dos candles anteriores. Uma boa barra de ignição fecha muito próxima do seu extremo e apresenta alto volume. Muitas vezes uma barra de ignição é também um gap de fuga, mas mantem-se a classificação de barra de ignição por ser mais forte.

É mais comum surgir de um momento arrastado de mercado ou quebrando uma congestão. Mas pode também ocorrer também dentro de um processo de retorno à média. Não se costuma fazer distinção entre uma barra de ignição e uma barra elefante no prazo de swingtrade do modelo.

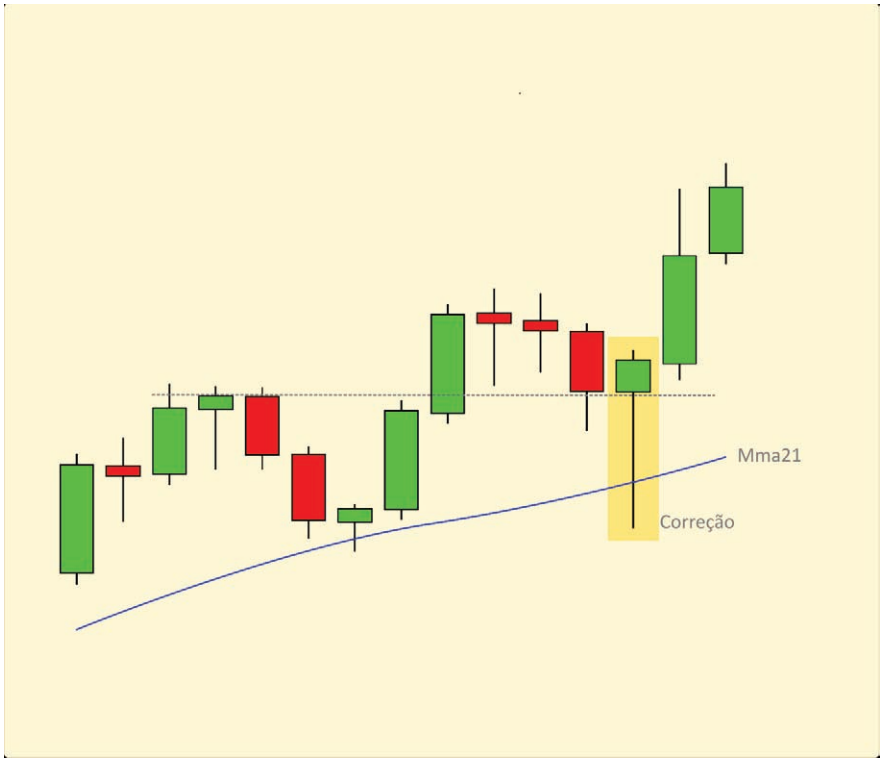


Correção

O trade de correção é essencialmente uma operação a favor da tendência. Se busca posicionamento no que acreditamos ser o final de uma perna corretiva e o início de uma perna expansiva a favor da tendência. Pode ser entendido também como o final de um trade de retorno a média, quando o preço já retornou para a média.

Aliás, esse tipo de operação está intimamente ligada à média móvel aritmética de 21 períodos (mma21). Nesse tipo de operação busca-se um sinal de reversão nas proximidades da mma21, tendo-a com a inclinação favorável ao movimento pretendido. O ideal é ter a média claramente sendo testada como suporte/resistência em conjunto com outras estruturas de suporte/resistência.

Quando o sinal se dá além da mma21, o sinal perde força. Se o sinal não for muito forte, costuma valer a pena aguardar o rompimento da média com uma barra de força, idealmente junto com o rompimento da linha de tendência terciária, se houver.



SETUPS

MÉTODO LEANDRO DE DAYTRADE

Introdução

Resumo

O método Leandro de day trade opera com três setups básicos, os quais também são encontrados de forma muito similar no método Bisi de daytrade (o qual foi inspirado no primeiro inclusive), mas são diferentes na abordagem.

Na origem, o método Leandro também se apoia em conceitos clássicos de análise gráfica, tendo sua parcela de subjetividade e consequentemente tomada de decisão discricionária. Mas, para sua utilização como modelo de trade na L&S Análise, optamos por desnudar ao máximo o modelo de análises subjetivas, aproximando-o ao máximo de um modelo objetivo que pudesse ser aplicado com facilidade por alguém que não domina a análise mais sutil do contexto de mercado. Dessa forma, são deixados de lado avaliações de viés, médias, volume etc.

Podemos então afirmar que o modelo o qual seguimos seria um modelo M. Leandro "simplificado" de daytrade. O método pode ser aplicado (seja na sua forma objetiva ou discricionária) em qualquer ativo, mas optamos por aplicá-lo de forma sistemática ao mini índice e ao mini dólar.

Entradas

As entradas são feitas no fechamento do candle que gerou o sinal. Não há necessidade de confirmação (superação da máxima ou perda da mínima do candle que rompeu). Para o rompimento ser válido, usamos um filtro 3 ticks acima/abaixo da máxima/mínima considerada.

Há planejamento de uma segunda entrada na metade da distância entra o ponto de entrada e o stop. Optamos por fazer essa segunda entrada somente quando ocorre candle favorável nas imediações desse valor, mas é possível deixar uma ordem esperando no livro de ofertas. Quando há execução para a segunda entrada, a fazemos no mesmo montante da primeira entrada.

OBS: o método aborta operações caso perceba um pregão do tipo “search and destroy” que pode ser identificado pelo fato do preço ter rompido a linha dágua para um lado e depois para o outro.

Stop

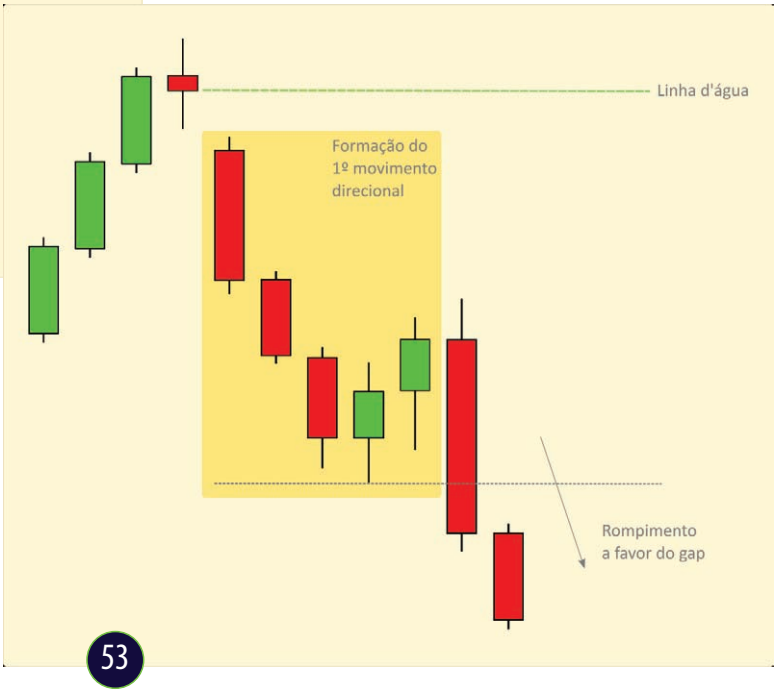
O stop de entrada tem como premissa uma distância mínima equivalente a 20% da média da volatilidade histórica (MVH) e/ou idealmente um posicionamento protegido por algum pequeno topo ou fundo. Para os setups 1 e 2, busca-se idealmente o stop além do extremo contrário do pregão. Existe um stop no tempo equivalente a 10 candles. Caso ocorra a segunda entrada, a contagem de 10 candles é reiniciada. Atingindo o stop no tempo, busca-se sair no preço equivalente ao zero a zero bruto da operação.

Alvo e manejo da posição

O alvo de realização parcial (RP) é projetado a partir do preço médio teórico (primeira e segunda entradas planejadas) e equivale a distância entre o preço médio projetado e o stop da operação. Uma vez atingida a RP, altera-se o stop do restante da posição para o preço da primeira entrada. A partir disso, se conduz a operação pelo indicador Hi-Lo Activator de 3 períodos. Ou seja, quando o Hi-Lo virar contrário à operação, o trade é fechado.

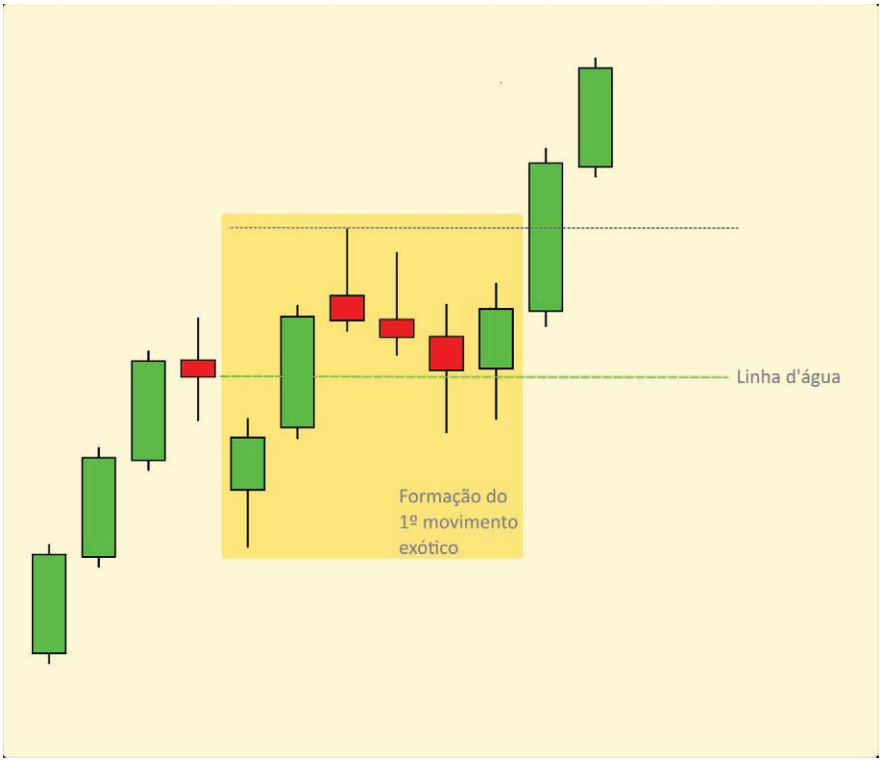
Setup 1

Podemos descrevê-lo de forma simplista como sendo o primeiro ziguezague do preço após a abertura. Geralmente com a abertura temos um movimento direcional de 2, 3 ou mais candles e depois um movimento contrário, marcando um primeiro movimento com início (abertura) e fim (início de correção) formando um ponto de inflexão (topo ou fundo). O setup é caracterizado pelo rompimento confirmado desse primeiro topo ou fundo formado pelo primeiro movimento dos preços. O padrão ganha relevância quando a abertura ocorre em gap, e respeitado pela correção necessária para formar o primeiro topo ou fundo. Melhor ainda, caso o gap nem venha a ser testado na correção. Via de regra, não se opera na direção contrário do gap. O primeiro movimento pode exibir várias formas. As duas mais usuais são a forma direcional e a lateral. Na primeira, como na figura 1, existe um pequeno rali nos preços antes da marcação do primeiro topo ou fundo. Nesses casos é importante que a correção que se segue não se aprofunde até a abertura. Já na segunda forma, o movimento é lateral como na figura 2. Ambas as formas são igualmente eficazes.



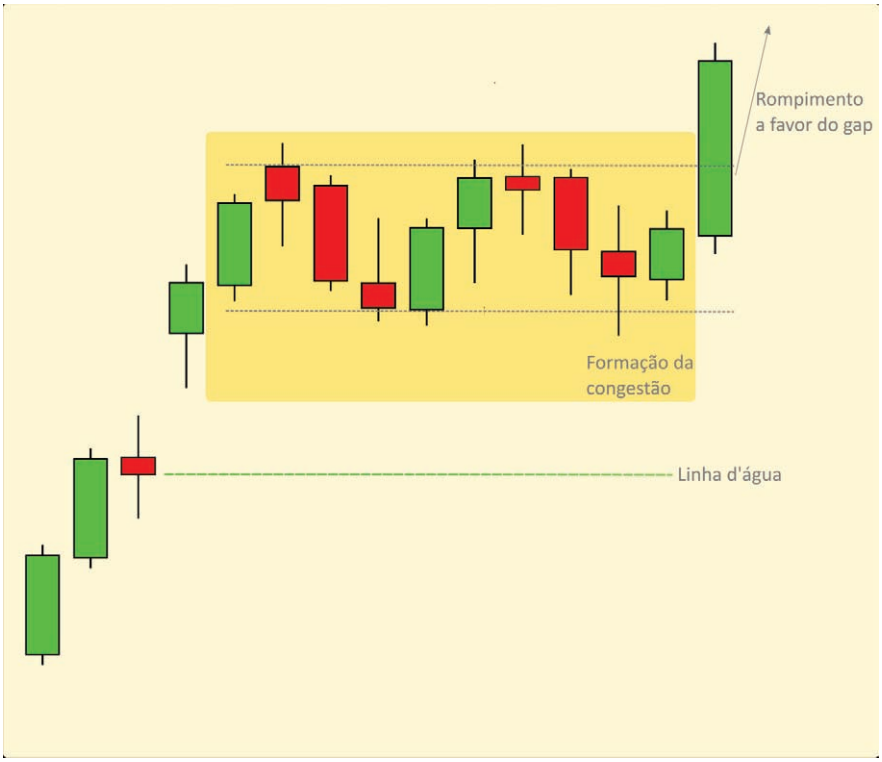
Setup 1 (movimento exótico)

Este setup é uma versão específica e menos frequente de primeiro movimento. Ocorre quando a abertura é em gap, mas de imediato o primeiro movimento que surge vai na direção contrária do gap, fechando-o parcialmente ou completamente. O padrão é mais relevante quando surge associado ao rompimento da linha d'água.



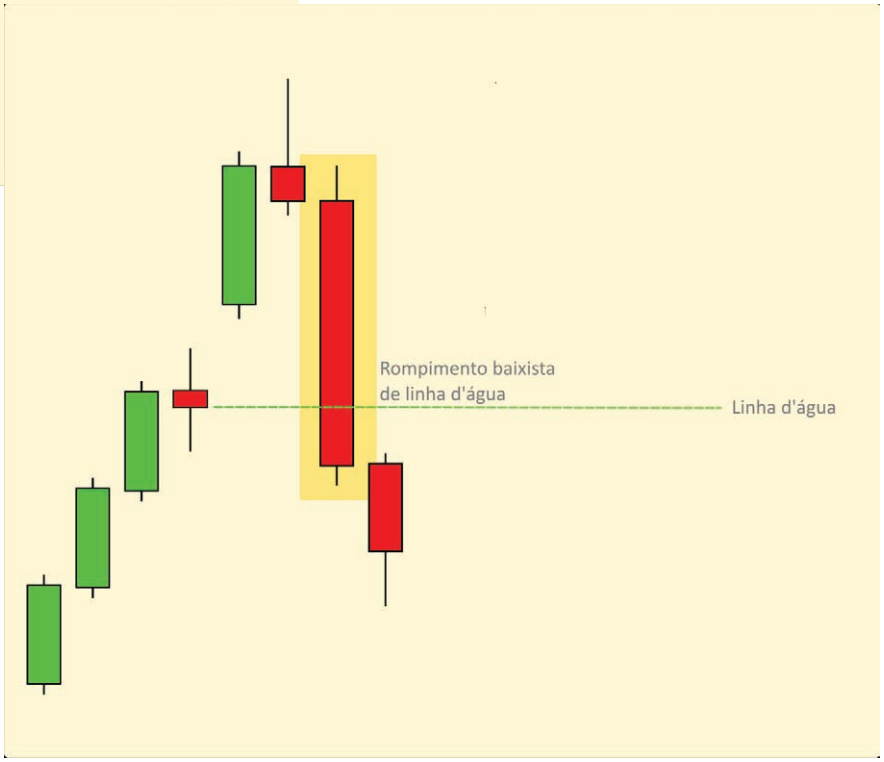
Setup 3

Refere-se ao rompimento de uma consolidação de, pelo menos, 10 candles. Essa estrutura de candles, também conhecida como retângulo, deve ser rompida somente a favor do gap. Dica: esse setup é mais seguro se ocorrido na parte da tarde.



Setup 2

Principalmente em pregões onde há a abertura em gap, costuma ser difícil para o preço romper a linha d'água para o lado oposto da abertura. Por marcar um ponto de transição entre força dominante compradora e vendedora, a linha d´água costuma ser defendida pela força vigente. No entanto, quando esse rompimento ocorre, a transição tende a ser permanente para o pregão, marcando uma virada da força dominante e, portanto, também sugerindo um provável avanço na direção do rompimento.

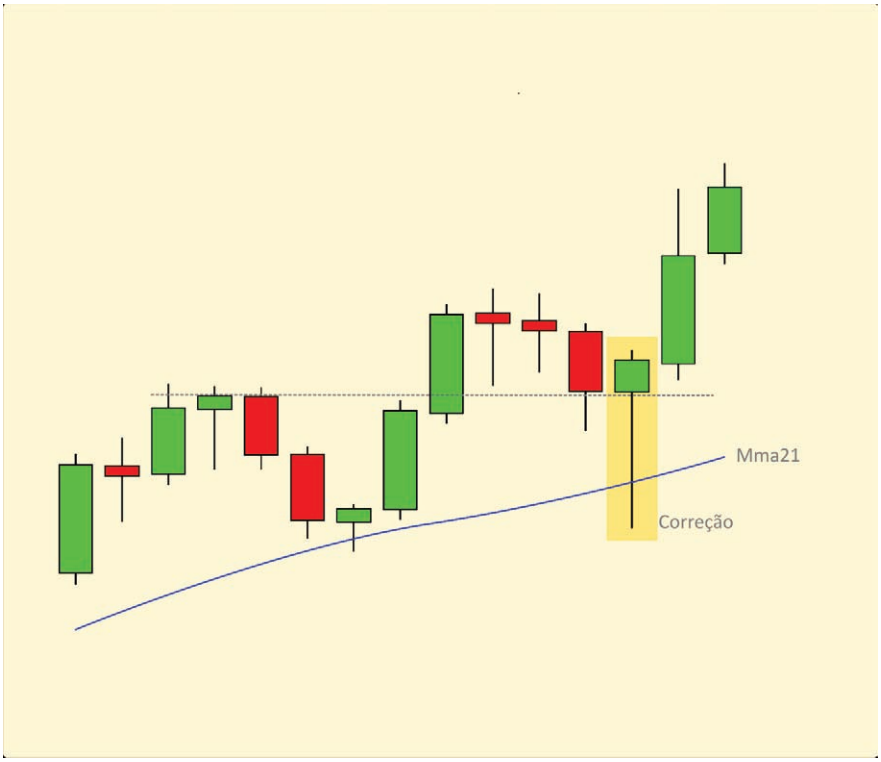


SETUPS

MÉTODO LEANDRO DE SWINGTRADE

Correção

O trade de correção é essencialmente uma operação a favor da tendência onde se busca posicionamento após uma perna de movimento corretiva, contra a tendência, na expecativa de se aproveitar desde o ínicio a perna expansiva que, espera-se, surgirá. Pode ser entendido também como o final de um trade de retorno à média, quando o preço já retornou para a média. Aliás, esse tipo de operação está intimamente ligada à média móvel aritmética de 21 períodos (mma21). Nesse tipo de operação, busca-se um sinal de reversão nas proximidades da mma21, tendo-a com a inclinação favorável ao movimento pretendido. O ideal é ter a média claramente sendo testada como suporte/resistência em conjunto com outras estruturas de suporte/resistência. Quando o sinal se dá além da mma21, o sinal perde força. Se o final não for muito forte, custuma valer a pena aguardar o rompimento da média com um sinal de força, idealmente junto com o rompimento da linha de tendência terciário, se houver.



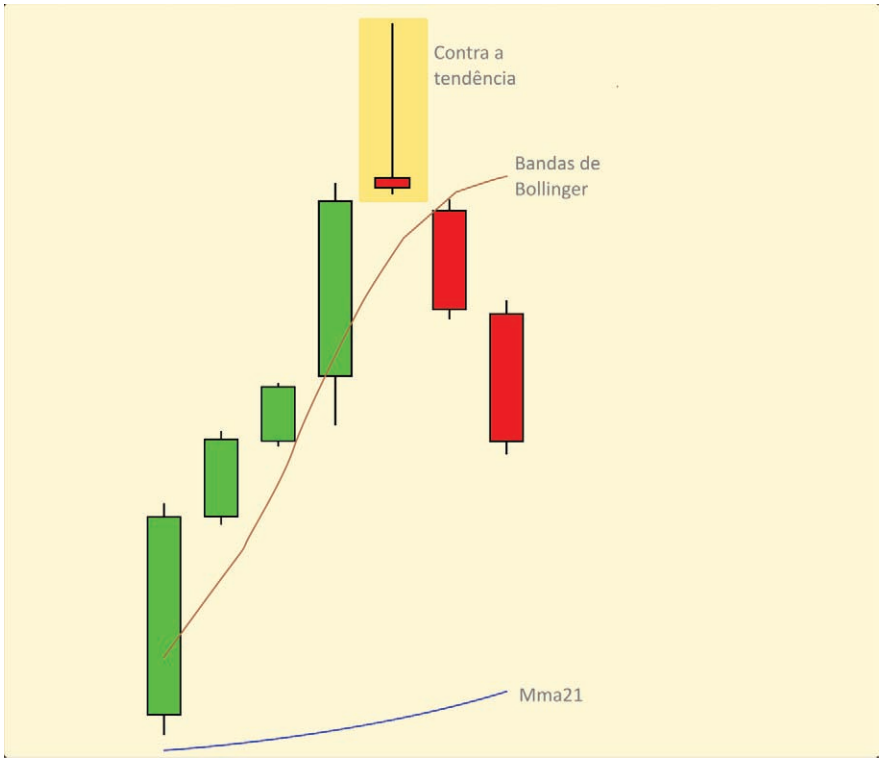
Rompimento

O rompimento é o argumento de trade mais frequente do modelo. Rompimentos podem se apresentar de várias formas, rompendo diferentes tipos de estruturas de resistência ou suportes. Usualmente o trade de rompimento se refere a uma estrutura de preço que é definida por dois ou mais topos/fundos (próximos ou distantes no tempo); ou ao rompimento de uma congestão de, no mínimo, 10 candles.

O rompimento se dá com candle fechado, com bom volume, que indique que a estrutura foi de fato vencida. Idealmente, não deve haver obstáculos imediatos ao trade, seja por estrutura de preço ou por médias móveis contrárias. Rompimentos que ocorrem com preço esticado, distante da mma21, ou vindo de uma já significativa sequência de candles direcionais, devem ser evitados.

Contra a tendência

Sabemos que o mercado anda em zig zag seguindo uma média de preços que tende a evoluir conforme o passar do tempo. Em momentos em que o mercado ganha muita força em uma direção, mas sem correções, ele se afasta de uma média normal de preços, fazendo com que ele fique “esticado” (muitas barras consecutivas na mesma direção). Obrigatoriamente, depois dessa corrida, os preços voltam a média: usamos dessa pernada de correção como uma oportunidade de entrar no mercado contra a tendência. Diferente do método Bisi ST, o método Leandro ST exige que o candle-sinal de entrada esteja fora das bandas de bollinger (usamos os parâmetros de 2 desvios e mma21).

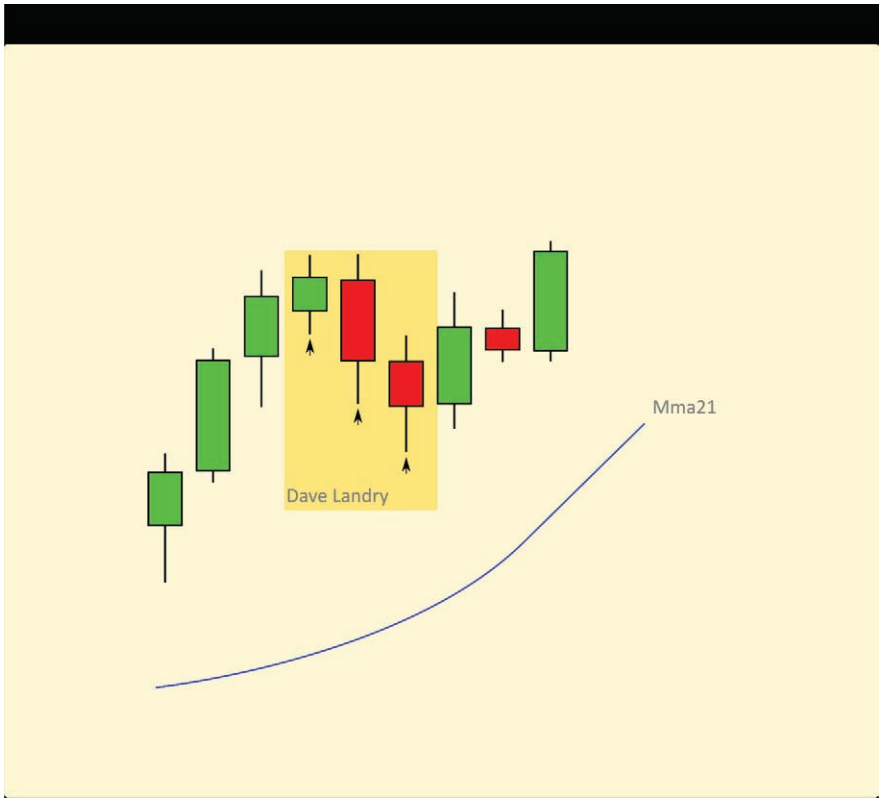


SETUPS

MÉTODO STORMER POSITIONTRADE

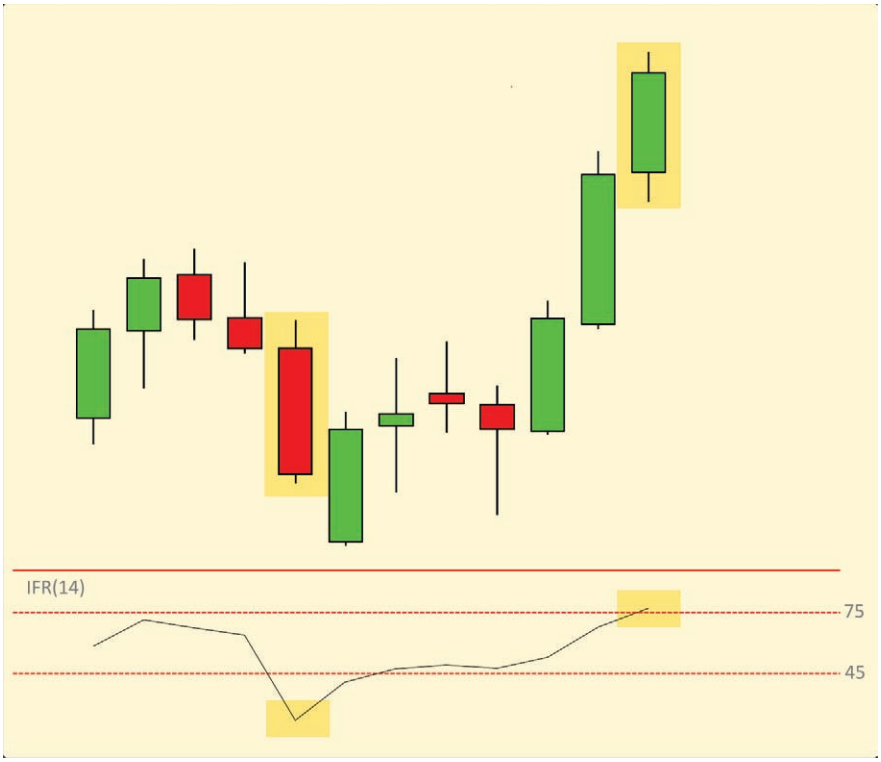
Dave Landry

Com os critérios de excelência Carolina cumpridos para compra, iremos esperar um candle que tenha sua mínima abaixo da mínima de dois candles prévios. Colocaremos uma ordem start de compra na superação de sua máxima, ou ainda, usamos um dos sinais de entrada (1-2-3- de compra ou Dunningan de alta) no gráfico diário para executarmos a compra. O stop fica um tick abaixo da mínima do candle que gerou a entrada. Iremos fazer uma realização parcial com 8% de ganho projetado a partir do ponto de entrada e iremos conduzir o restante da posição por metria fixa.



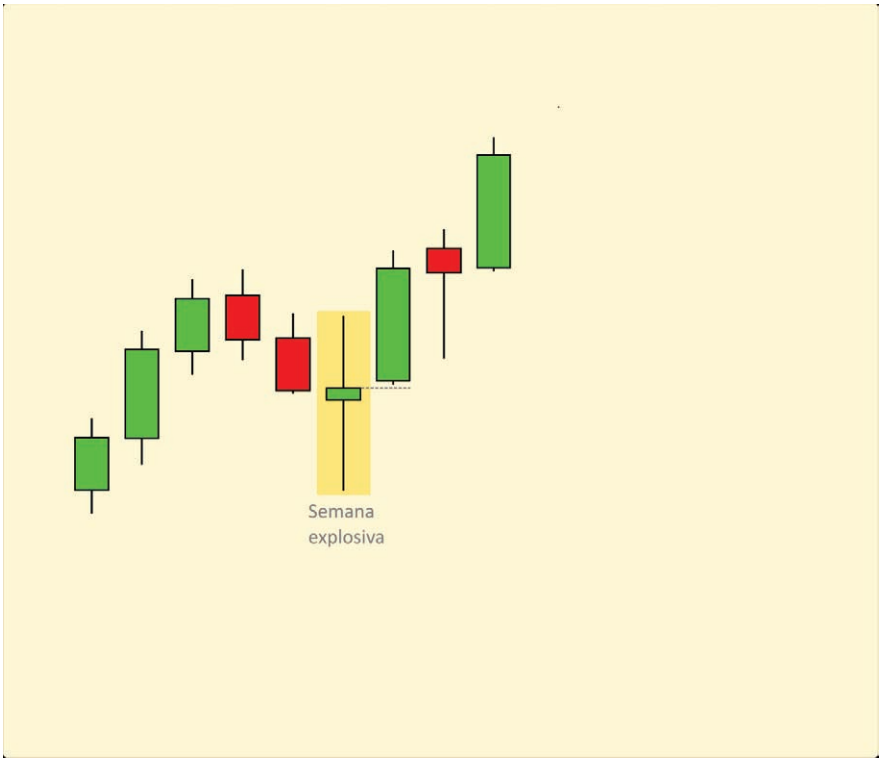
IFR14 ajustado

Colocamos o indicador ifr de 14 períodos no gráfico semanal. Afastamos o gráfico o máximo possível e marcamos os limites de excursão deste (limites superior/inferior que englobe o maior número de topos/fundos. Quando o ativo estiver sobrevendido (usualmente, nas proximidades de 45) nesse gráfico ajustado, iremos refinar a entrada no diário, usando um dos dois sinais de entrada (Dunningan de alta no diário ou 1-2-3 de compra). O stop fica um tick abaixo da mínima da semana. O setup não tem um alvo fixo: conduziremos a operação até o limite de sobrecompra (usualmente, nas proximidades de 75) do ativo pelo ifr14 ajustado. Quando esse nível for atingido, sairemos da operação assim que acontecer um 1-2-3 de venda ou um Dunningan de venda.



Semana explosiva (Blast off)

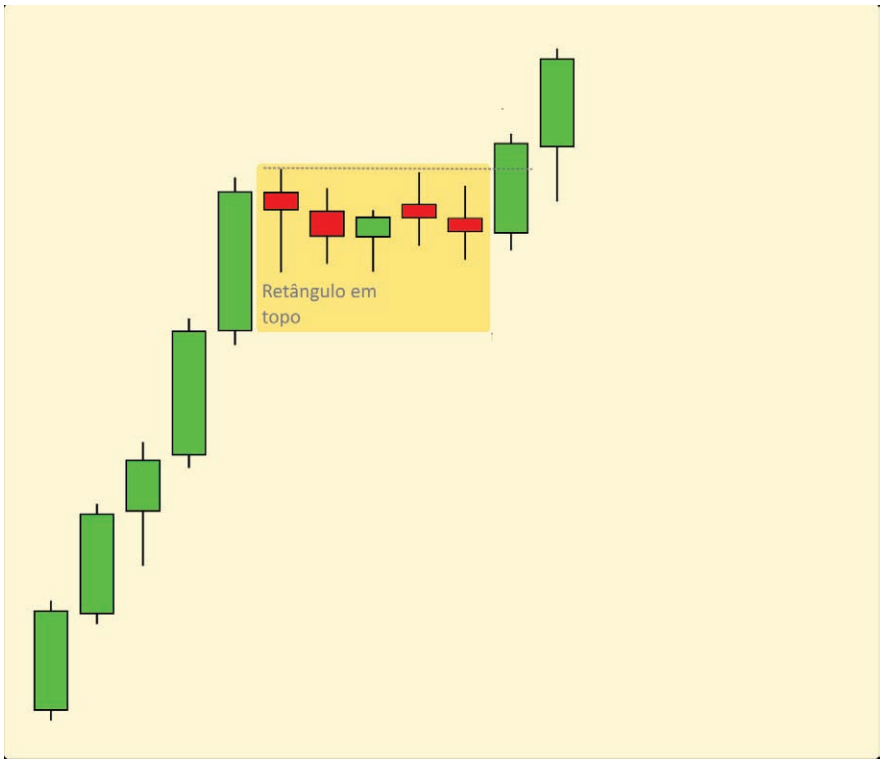
Blast off é o nome dado ao candle que apresenta longas sombras superiores e inferiores, com o corpo o mais estreito possível. Esse padrão pode ser visto com uma contração dos preços, como o mercado se movimento de forma alternada, o que se espera na semana seguinte é uma expansão dos preços. Por isso, caso na segunda-feira o papel abra acima do fechamento da semana anterior, entramos comprando logo na abertura. O stop fica um tick abaixo da mínima do candle blast off; fechamos o trade perto do encerramento do pregão da sexta-feira, tentado capturar um movimento mais amplo..



Retângulo em topo para cima

Seguiremos os seguintes passos para identificar esse padrão:

1- Iremos procurar um ativo que tenha cumprido uma movimentação íngreme de alta com uma amplitude maior que 50% de ganho.
2- Esperemos que ele forme uma congestão em topo; esse retângulo não pode ter uma amplitude superior a 10% do movimento da pernada de alta.
3- Assim que houver o rompimento para cima do retângulo, iremos compra o papel, colocando o stop na mínima do retângulo. O alvo é a projeção da perna de alta projetada a partir do último fundo do retângulo.



Duas semanas de queda

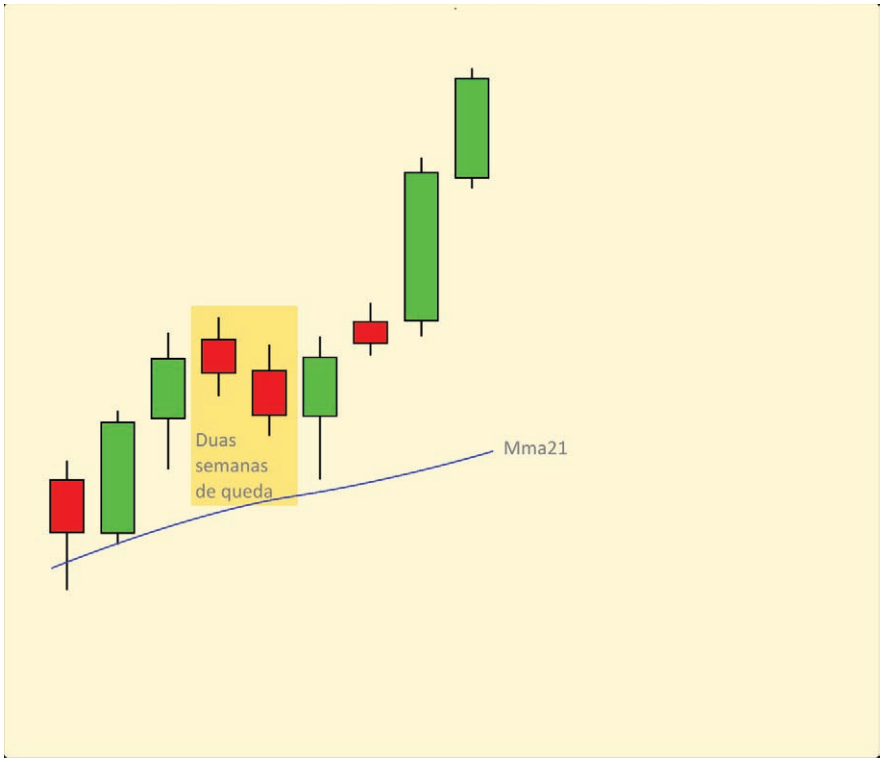
Com os critérios Carolina de excelência para compra, esperamos duas barras baixistas no gráfico semanal. Na sexta feira que olharmos isto presente, temos três condutas possíveis:

1- Calculamos o fura teto (amplitude da barra multiplicada por 0,14 e adicionada a máxima do candle sinal) e colocamos uma ordem start de compra nesse preço (conduta mais confortável, menos trabalho e mais medrosa).

2- Colocamos start de compra na máxima do último candle (caso não acione, baixamos a ordem para a mínima do candle da semana anterior, e vamos fazendo isso até violar alguma máxima e entrarmos na operação).

3- Entramos no gráfico diário e procuramos, na semana seguinte, por um dos dois sinais de entrada na compra : o 1-2-3 ou o Dunningan de alta.

O stop fica na mínima do candle que produzimos a entrada, planejamos uma realização parcial em 8% a partir do ponto de entrada e conduzimos o restante da operação por metria fixa.

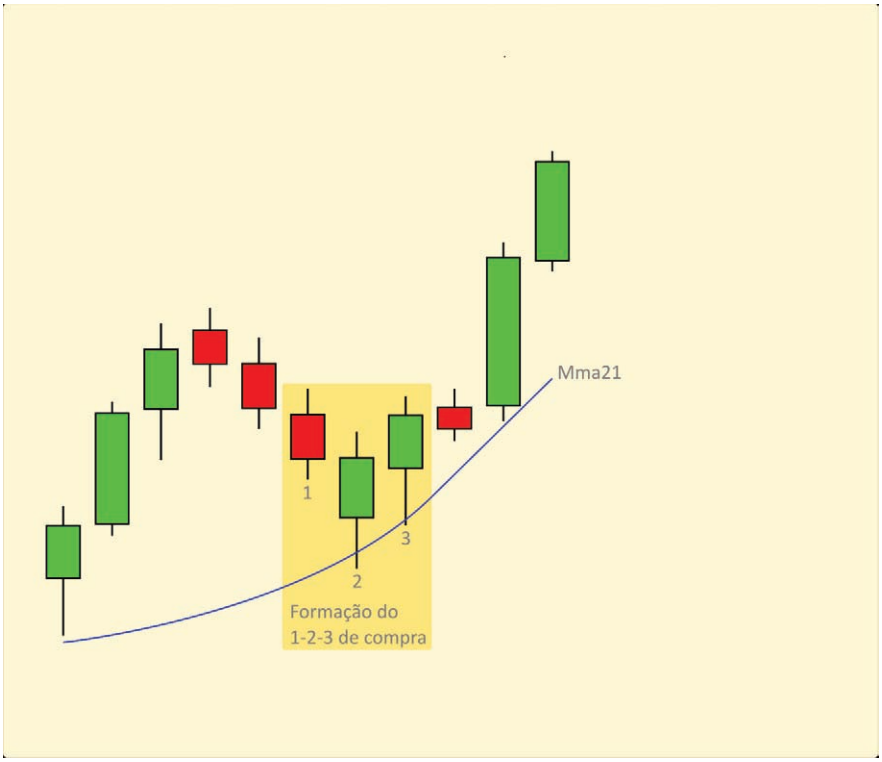


SETUPS

MÉTODO STORMER SWINGTRADE

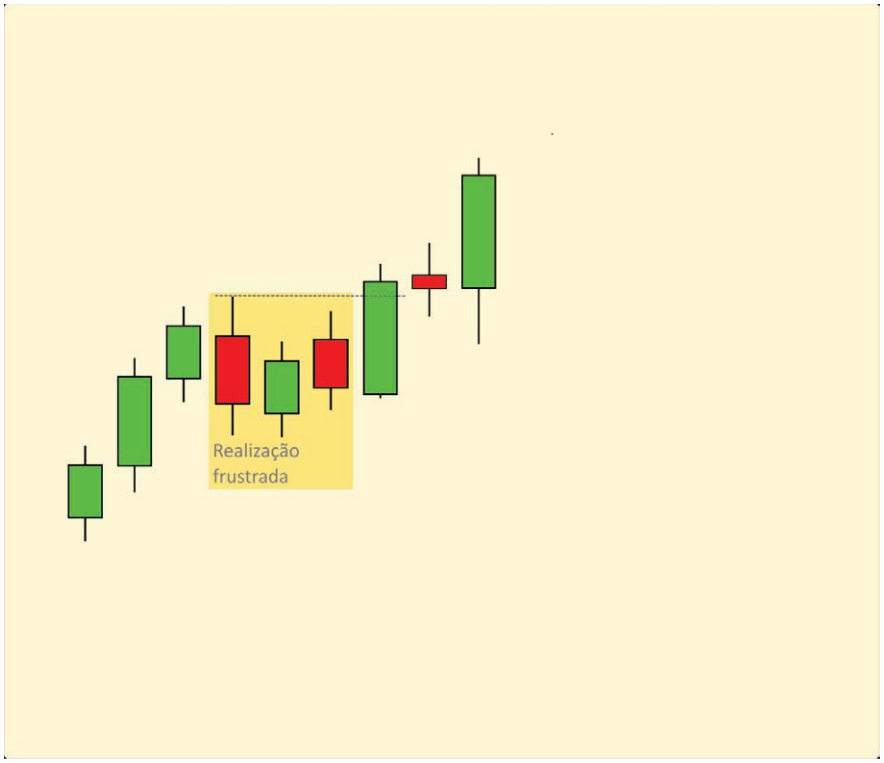
1-2-3

O 1-2-3 é uma forma muito simples de localizar um fundo ou um topo no mercado. A forma de encontrar um fundo é basicamente ir observando as mínimas dos candles. Ao localizar mínimas mais baixas, estamos dentro de uma perna de baixa. Quando tivermos localizado um candle que tenha a sua mínima antecedida por um candle com mínima acima e seguido por um candle que tenha sua mínima também acima deste, teremos localizado um fundo. .



Realização frustrada

A filosofia deste setup é entrar no stop da ponta contrária a tendência do movimento vigente. Assim, para um compra, esperamos que a seguinte sequência de candles aconteça: candle de baixa, candle de alta, candle de baixa. O start de compra fica no máxima do conjunto, o stop na mínima dele, e o alvo é no mínimo 100% da projeção – podendo também ser trabalhado com um alvo mais longo, de 160%, principalmente se o padrão se dá em cima de um suporte e a tendência de alta for sólida.



Setups

IFR2

Básico sobre o setup:

Não existe Stop no preço nesse sistema!!!!!!!!!!!!

Consideramos o indicador de força relativa de dois períodos para determinar o nível de sobrevenda dos ativos. Usamos o nível de 30 para uma lista de papéis selecionados de acordo com configurações específicas de backtests.

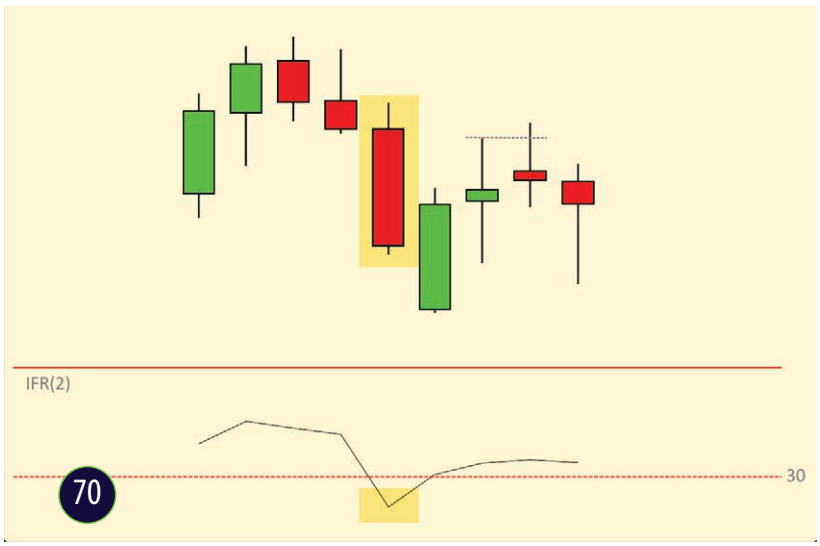
Esperamos o papel estar com o seu IFR2 abaixo de 25 para comprarmos, mas só efetuamos a operação nas proximidades do fechamento do mercado à vista (geralmente, 10 minutos antes do início do leilão de fechamento).

Saída do modelo :

1- Máxima dos dois últimos dias (SEM CONTAR o atual).
OU
2- Sétimo dia util após a entrada, no fechamento.

Lista de ativos operáveis pelo IFR2 (Atualizado em Julho/2019):
Top 5 as melhores : EQTL3 , B3SA3, TRPL4, SANB11 E PSSA3
Abev3 , azul4, b3sa3, bbse3 , bova11 (com duas entradas) , brml3, ccro3, cesp6, csan3, Ecor3, Egie3, Enat3, Eqtl3, Eztc3, Grnd3, Hype3, Igta3, Itub4 (duas entradas) , Lcam3, Lren3, Mdia3, Mult3, Odpv3, Pssa3, Qual3, Rail3, Rapt4, Rent3, Sanb11 , Sbsp3, Seer3, Taee11, tgma3, tots3, Trsi3, Unip6, Vivt4, Wege3

Exemplo de operação: .



SETUPS

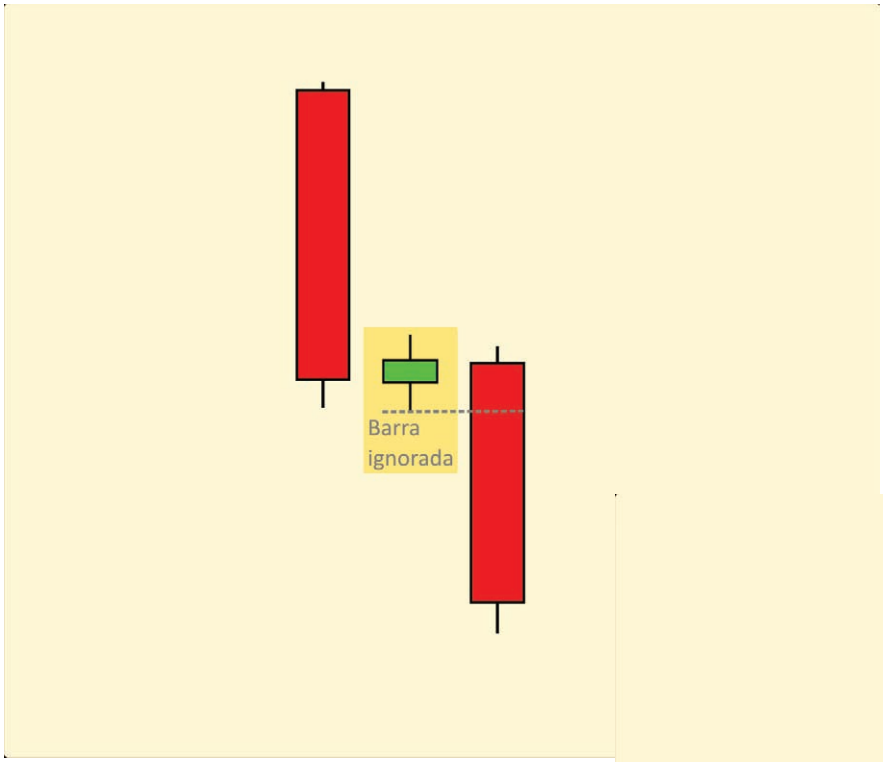
MÉTODO WILLIAM DAYTRADE

Red Bar Ignored (RBI) / Green Bar Ignored (GBI)

Este evento serve para adicionar posições ou fazer entradas atrasadas em trades que já deram uma entrada inicial. Basicamente é uma pequena barra vermelha/verde situada entre duas barras verdes/vermelhas, podendo ter pequenas sombras em suas extremidades. O trade é acionado na superação da máxima/mínima da pequena barra vermelha/verde ignorada.

Localizações: Não tem

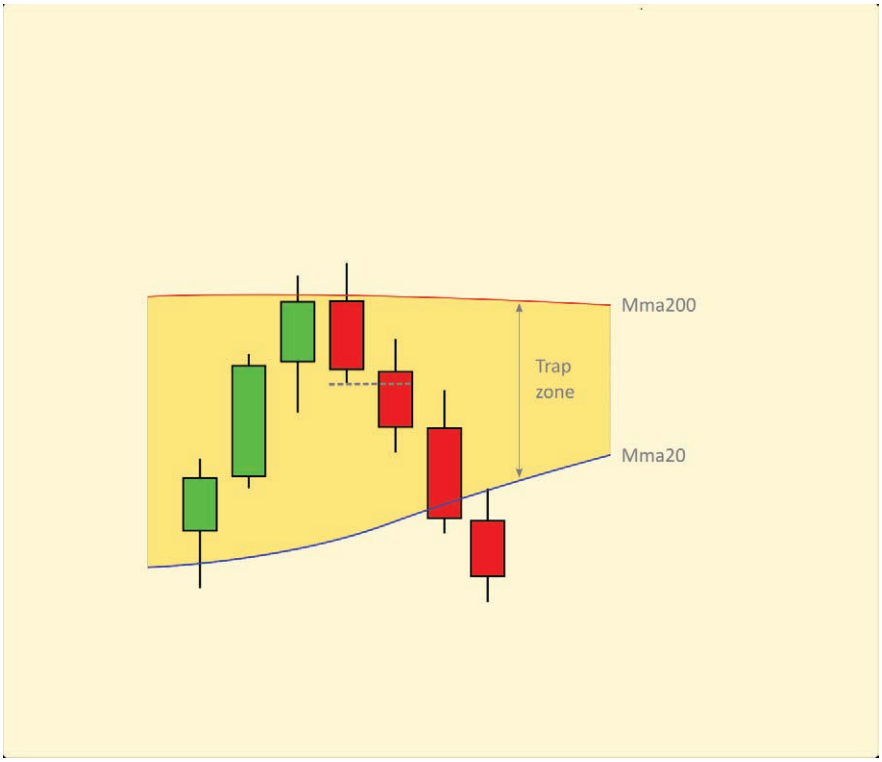
Stop Gráfico: Abaixo/acima da mínima/máxima da barra vermelha/verde ignorada.



Trap Zone (TZ)

É o espaço compreendido entre as duas médias principais que utilizamos. Numa condição destas damos o benefício da dúvida para a média de 200 períodos. Se os preços estiverem abaixo da média de 200, mas em cima da de 20, aguardamos a formação de algum evento de venda (configuração contrária ao cenário de compra).

Stop: Utilizar o stop do evento gerado



Top Tail Take Out (TTTO) / Bottom Tail Take Out (BTTO)

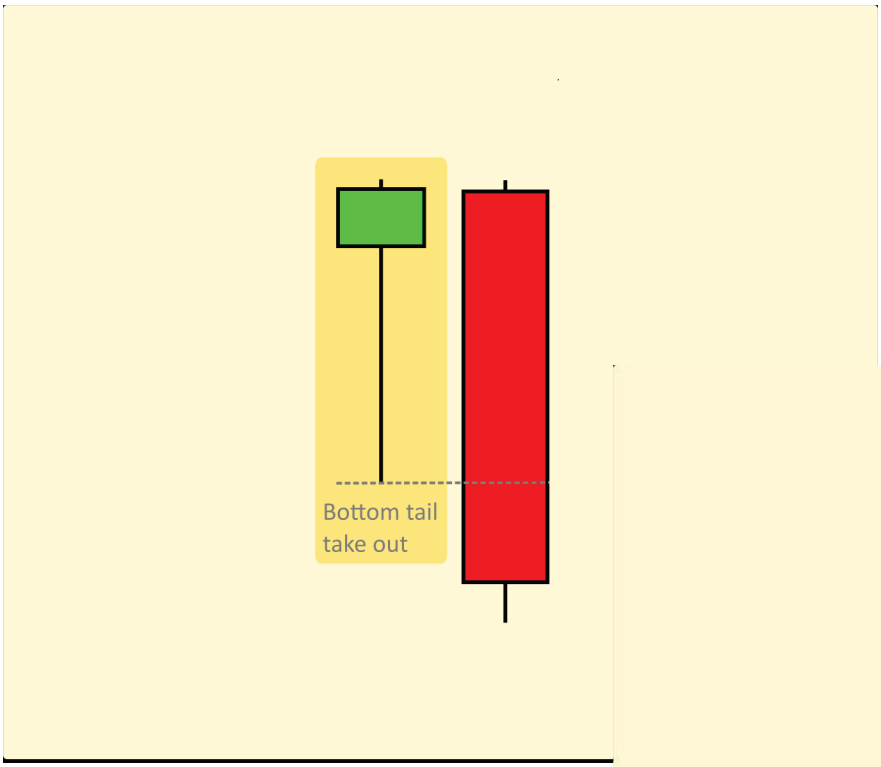
Este é um dos eventos mais negligenciados em grande parte por causa da cauda superior que dá um viés negativo para esta barra. Porém quando ocorre costuma gerar movimentos amplos em grande parte pela frustração do sinal de venda ignorado. Costuma ser mais efetivo depois de uma queda.

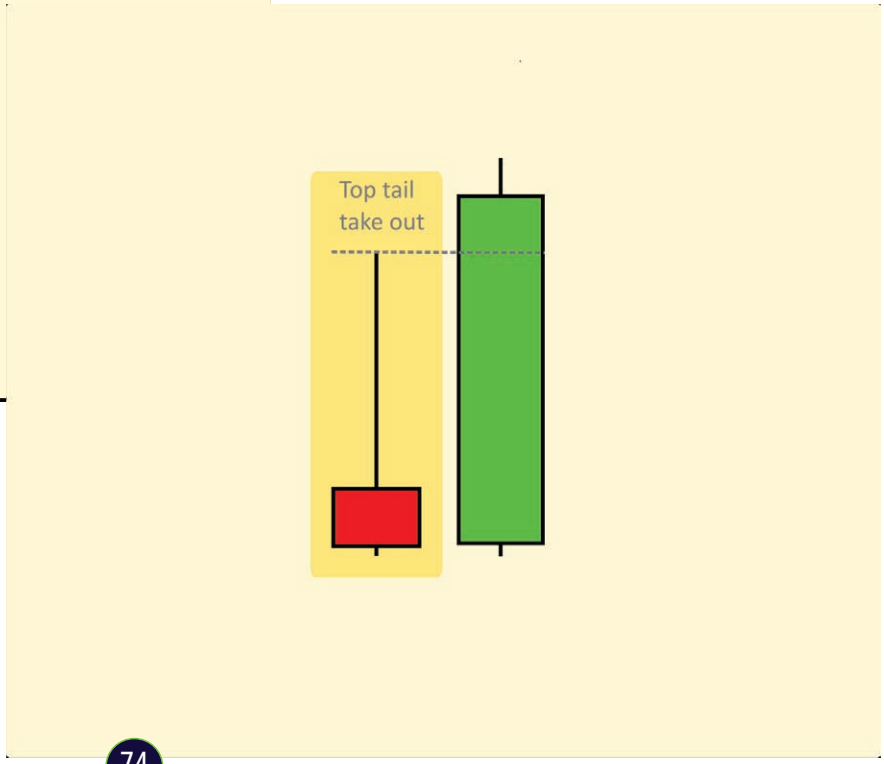
Localizações: LOC1, LOC2, LOC3 e LOC4

Stop Gráfico: Abaixo da mínima da Topping Tail.

Stop Alternativo 1: Abaixo da mínima da barra que gerou a entrada.

Stop Alternativo 2: Em 55% da distância entre a máxima e a mínima da Topping Tail.





Filling the Gap (FTG)

A forma de analisar é preenchendo o gap de acordo com a direção da barra como se houvesse tido negociação naqueles pontos. Opera-se da mesma forma como se opera as barras elefantes.

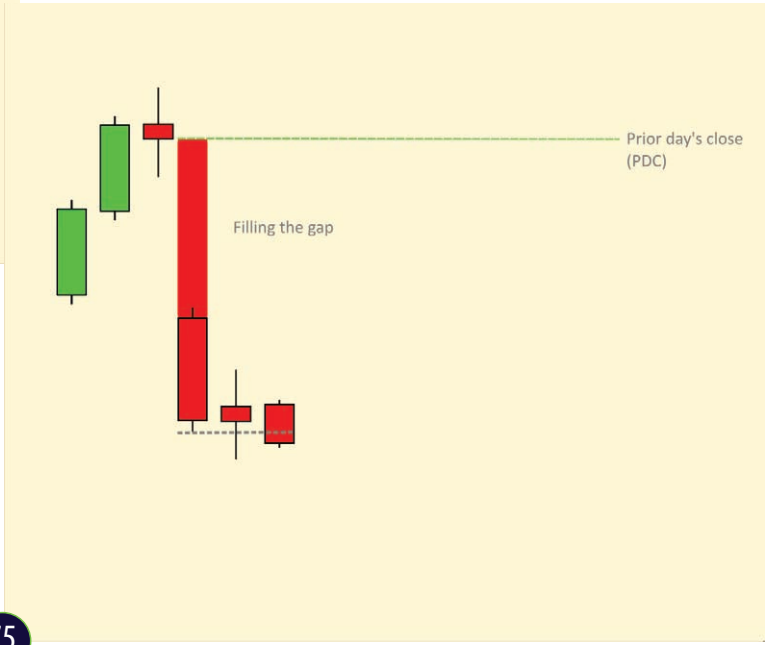
Localizações: LOC1, LOC2, LOC3 e LOC4

Stop Gráfico: Abaixo/acima do fechamento do gap.

Stop Alternativo 1: Abaixo/acima da mínima/máxima da barra que gerar a entrada.

Stop Alternativo 2: Em 55% da distância entre a máxima da primeira barra e o fechamento do gap.

PDC (Prior day's close): linha d'água



Barra Elefante (BE)

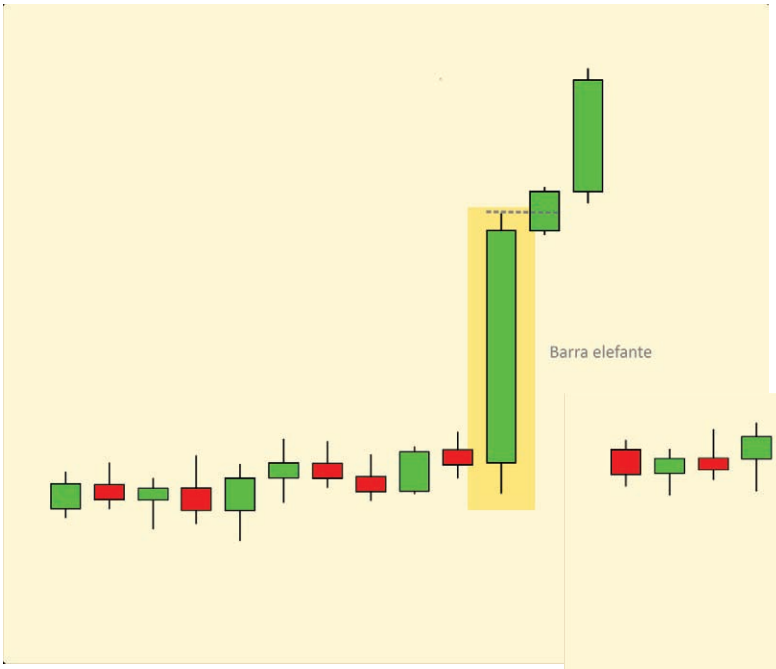
Esta barra deve ter mais verde/vermelho do que 70% de todas as barras anteriores (últimas 20 barras), preferencialmente "limpando" essas barras. A barra elefante pode ter pequenas sombras, sendo que todo o espaço compreendido entre a máxima e a mínima é área de compra/venda.

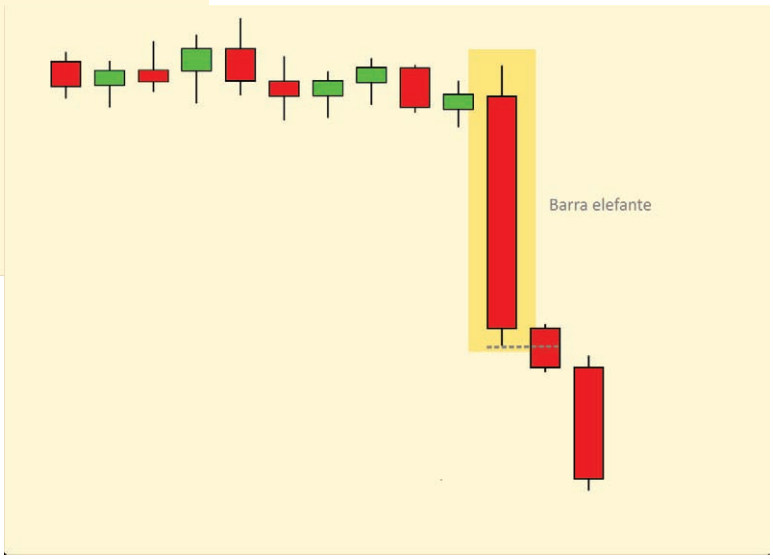
Localizações: LOC1, LOC2, LOC3 e LOC4

Stop Gráfico: Abaixo/acima da mínima/máxima da barra.

Stop Alternativo 1: Abaixo/acima da mínima/máxima da barra que gerou a entrada.

Stop Alternativo 2: Em 55% da distância entre a máxima e a mínima da barra.

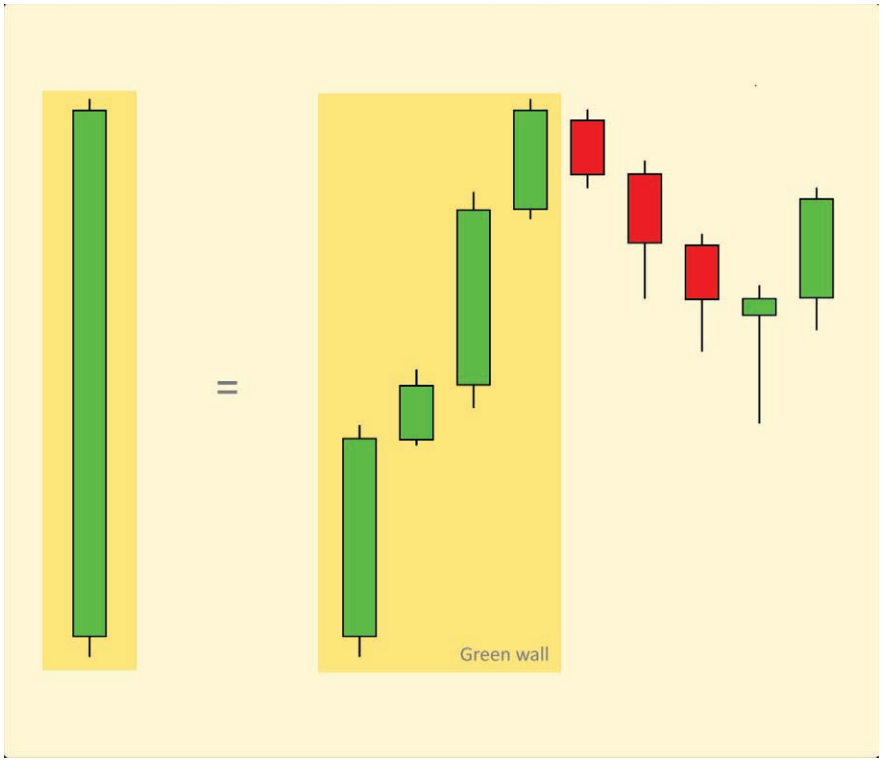




Green Wall (GW)

Condição de mercado onde o mesmo apresenta grande força numa direção, formando uma "parede", ignorando elementos de suporte e resistência. Comum após grandes gaps e devem ser consideradas barras elefantes ao juntar visualmente as barras em sequência.

Stop: Utilizar os stops utilizados nas barras elefantes.



Bull 180º / Bear 180º

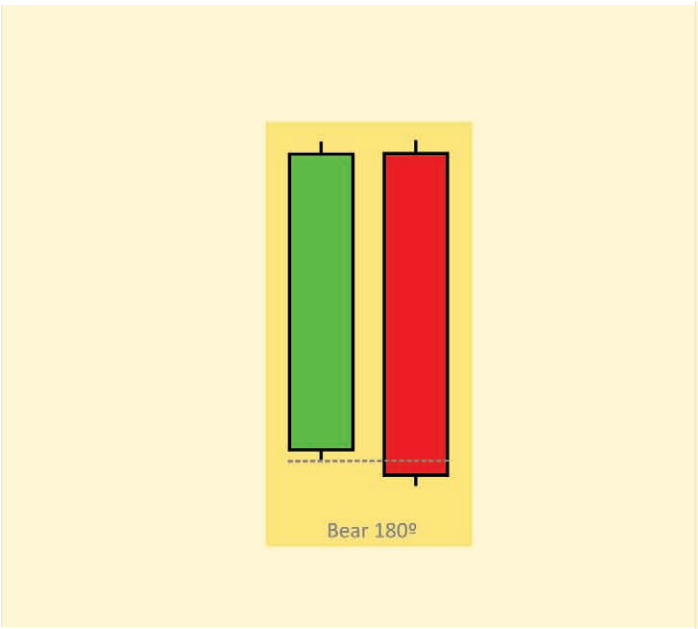
Este evento ocorre quando há a eliminação de toda a amplitude da barra anterior, podendo ter ou não pequenas sombras. Ambas as barras são grandes quando comparadas com as barras mais recente.

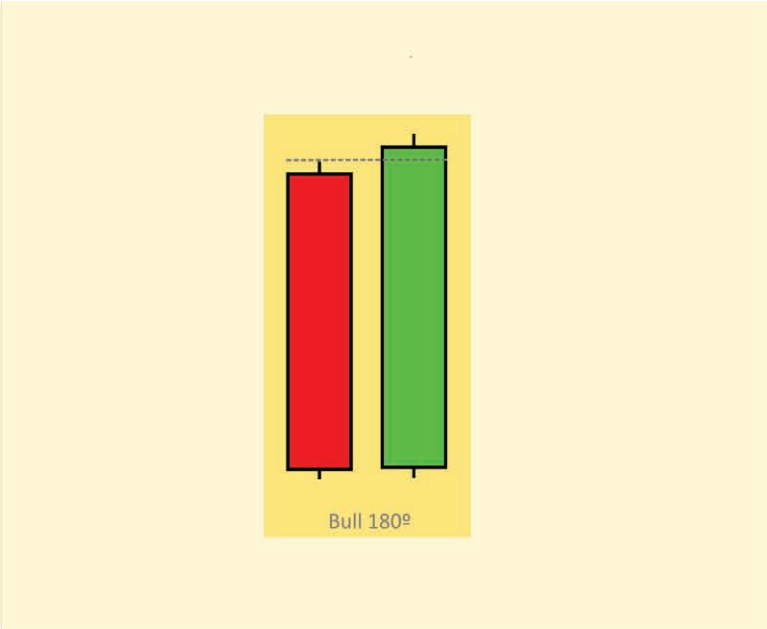
Localizações: LOC1, LOC2, LOC3 e LOC4

Stop Gráfico: Abaixo/acima da mínima mais baixa/alta das duas barras.

Stop Alternativo 1: Abaixo/acima da mínima/máxima da barra que gerou a entrada.

Stop Alternativo 2: Em 55% da distância entre a máxima e a mínima das duas barras..





Localizações (LOC)

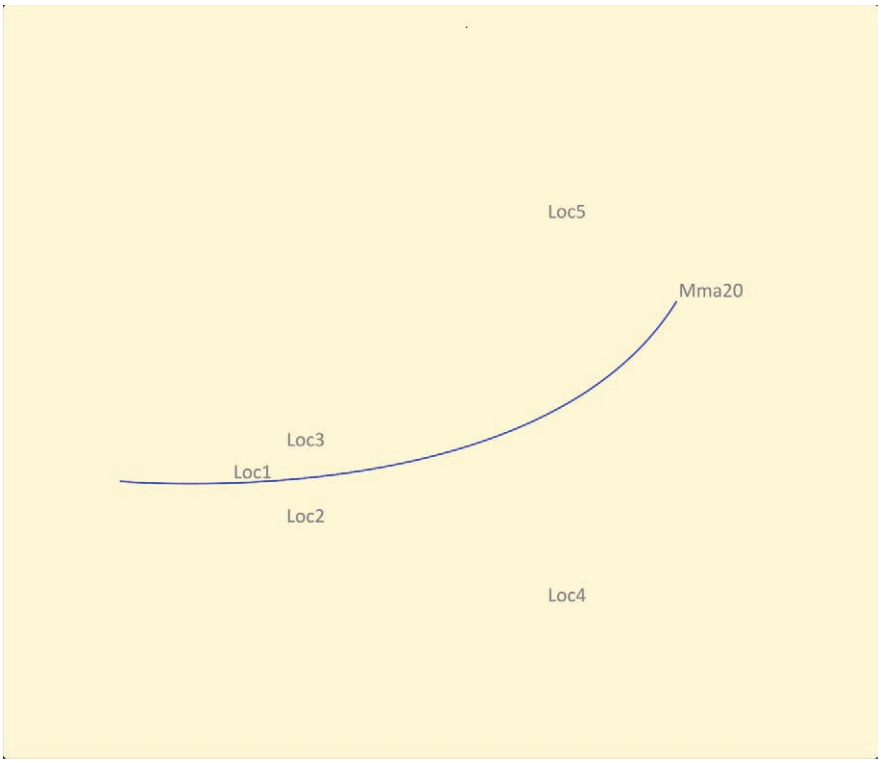
Loc1 – Sobre a mma20, se um evento ocorre na região o mesmo deve ser operado.

Loc2 – Pouco abaixo da mma20, se um evento ocorre um pouco abaixo da média sem tocá-la o mesmo deve ser operado.

Loc3 – Pouco acima da mma20, se um evento ocorre um pouco acima da média sem tocá-la o mesmo deve ser operado.

Loc4 – Muito abaixo da mma20, se um evento ocorre visualmente longe da média o mesmo deve ser operado de modo mais agressivo na compra.

Loc5 – Muito acima da mma20, se um evento ocorre visualmente longe da média o mesmo deve ser operado de modo mais agressivo na venda.



Bottom Tail (BT) / Top Tail (TT)

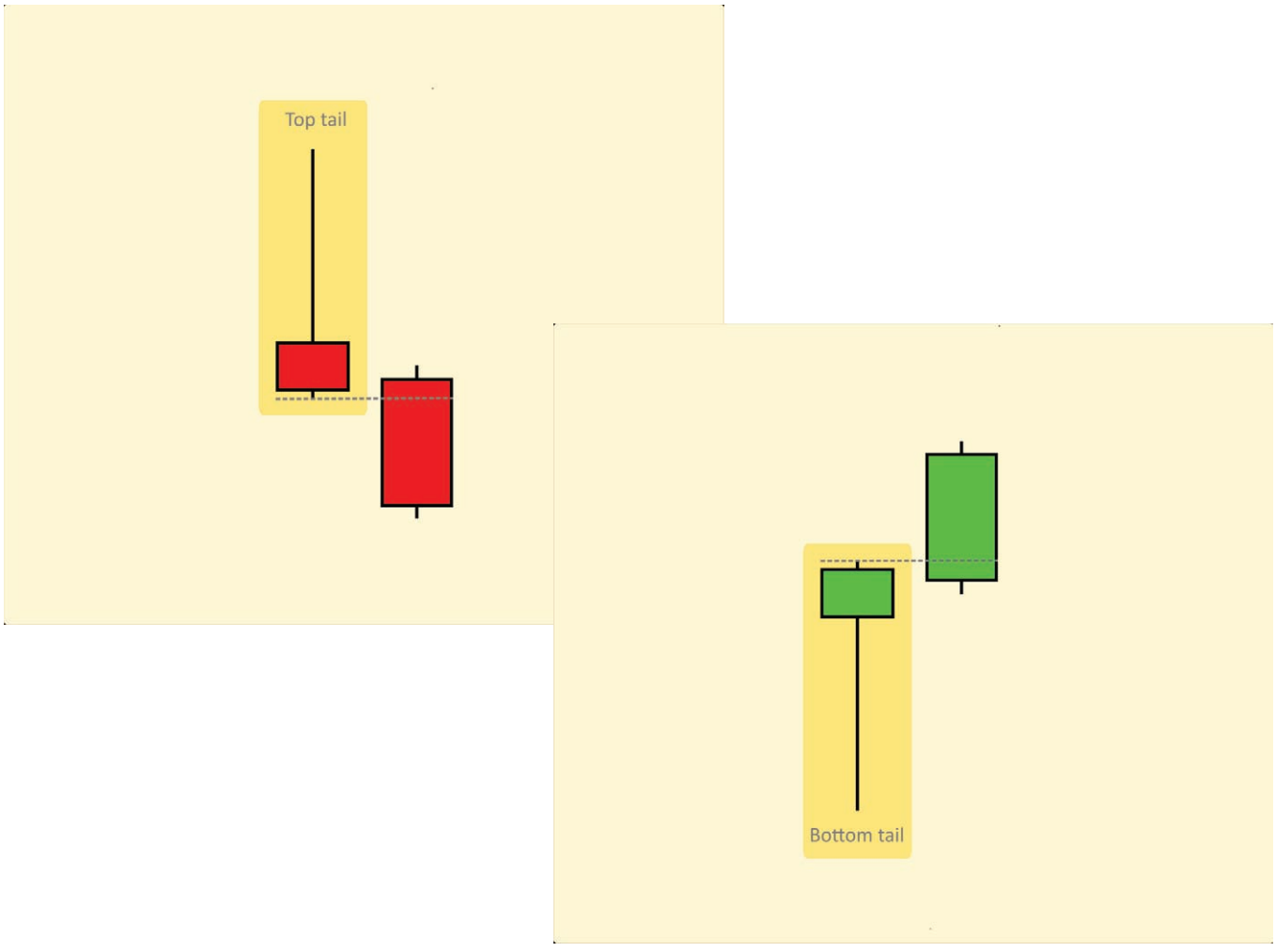
A cauda destas barras corresponde a 2/3 ou mais de sua amplitude e pode ter o seu topo verde, vermelho ou sem cor. A cauda indica que ocorreu uma grande mudança no equilíbrio de forças.

Localizações: LOC1, LOC2, LOC3 e LOC4

Stop Gráfico: Abaixo/acima da mínima/máxima da sombra.

Stop Alternativo 1: Abaixo/acima da mínima/máxima da barra que gerou a entrada.

Stop Alternativo 2: Em 55% da distância entre a máxima da barra e a mínima da sombra.

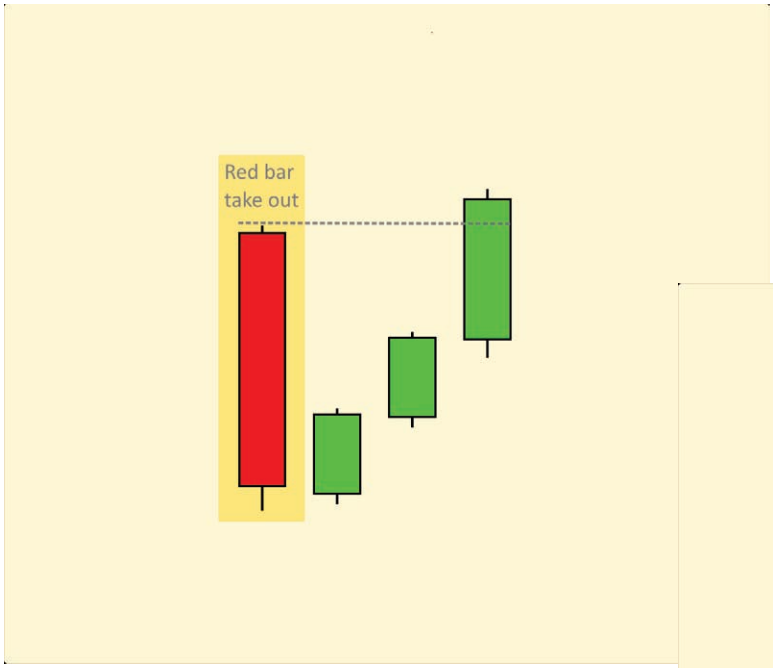
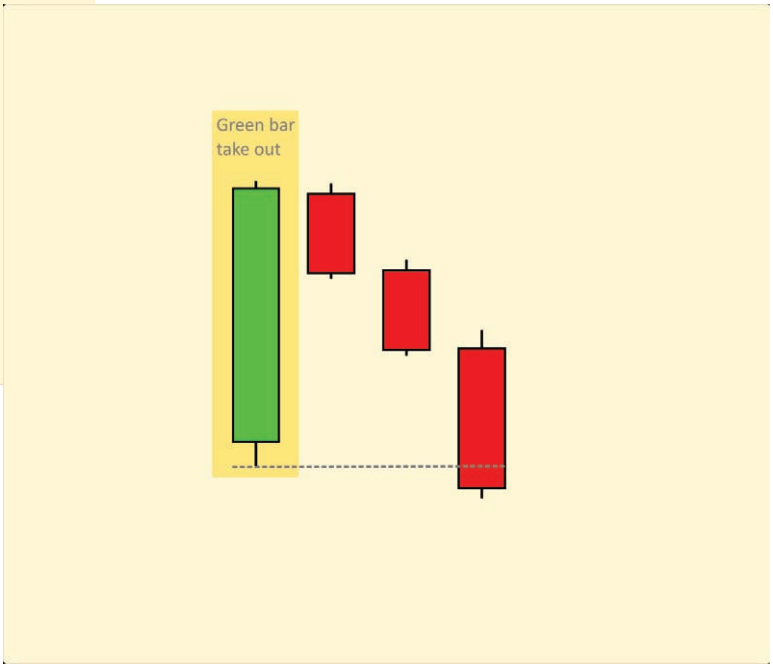


Green Bar Take Out (GBTO) / Red Bar Take Out (RBTO)

Este evento ocorre quando há a eliminação de toda a amplitude da barra anterior de queda. Em essência é um Bull 180/Bear 180 que precisa de duas ou mais barras para eliminar a máxima da barra de queda. Este aspecto de compra mais atrasado às vezes faz ele um pouco mais forte do que o Bull 180/Bear180.

Localizações: LOC1, LOC2, LOC3 e LOC4

Stop Gráfico: Abaixo/acima da mínima/máxima mais baixa/alta das duas primeiras barras.

Stop Alternativo 1: Abaixo/acima da mínima/máxima da barra que gerou a entrada.

Stop Alternativo 2: Em 55% da distância entre a máxima e a mínima das duas primeiras barras.